

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年8月16日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 小池 広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型 グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型 グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型 グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	(1)当初募集額 グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型 1,000億円を上限とします。 グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型 1,000億円を上限とします。 グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型 1,000億円を上限とします。 グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型 1,000億円を上限とします。 (2)継続募集額 グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型 3兆円を上限とします。 グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型 3兆円を上限とします。 グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型 3兆円を上限とします。 グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型 3兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2020年10月19日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に変更がありますので本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況

また、それ以外の訂正事項につきましては、＜訂正前＞および＜訂正後＞に記載している下線部__は訂正部分を示し、＜更新後＞の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。

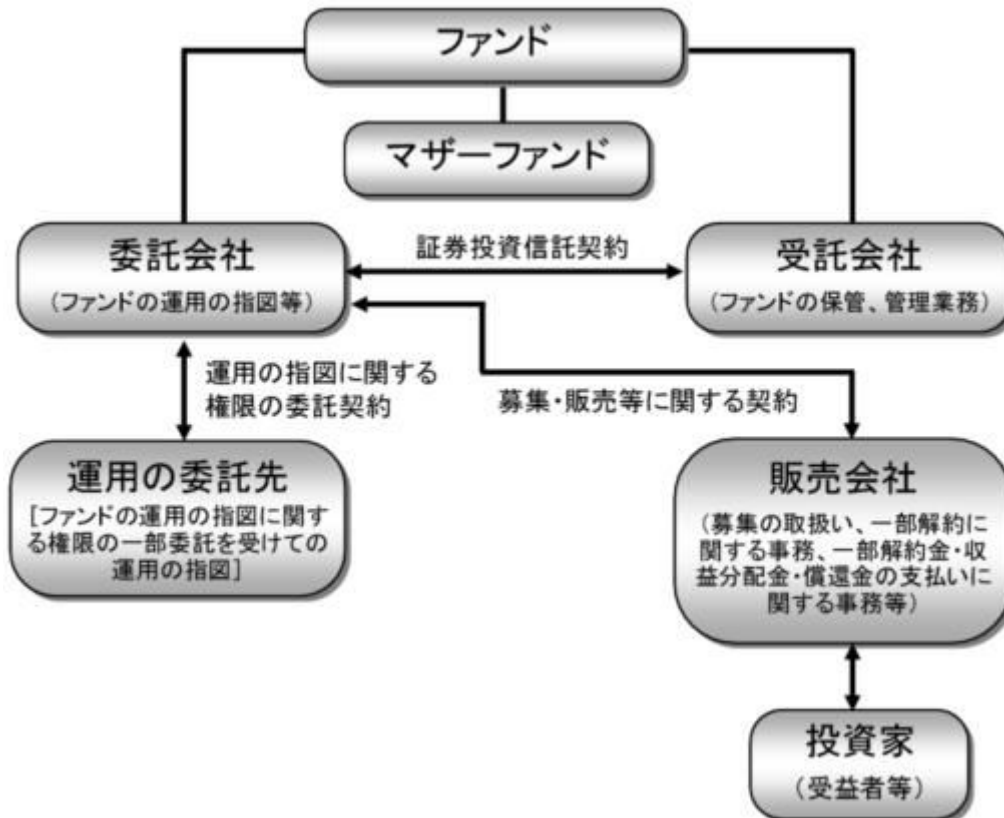
第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

<更新後>



ファンド	グローバルESG バランスファンド (為替ヘッジあり) 年2回決算型	グローバルESG バランスファンド (為替ヘッジなし) 年2回決算型	グローバルESG バランスファンド (為替ヘッジあり) 隔月分配型	グローバルESG バランスファンド (為替ヘッジなし) 隔月分配型
マザーファンド (親投資信託)	ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド 米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド 米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド ACI ESGグローバルREIT マザーファンド			
委託会社 (委託者)	野村アセットマネジメント株式会社			
受託会社 (受託者)	野村信託銀行株式会社			
	アメリカン・センチュリー・インベストメント・マネジメント・インク (American Century Investment Management, Inc.)			

運用の委託先	ノムラ・アセット・マネジメント・U.K.・リミテッド (NOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED)
--------	--

- ファンドはマザーファンドを通じて投資するファミリーファンド方式で運用します。



< 更新後 >

委託会社の概況(2021年6月末現在)

- ・ 名称

野村アセットマネジメント株式会社

- ・ 資本金の額

17,180百万円

- ・ 会社の沿革

1959年12月1日

野村證券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

- ・ 大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋1-13-1	5,150,693株	100%

2 投資方針

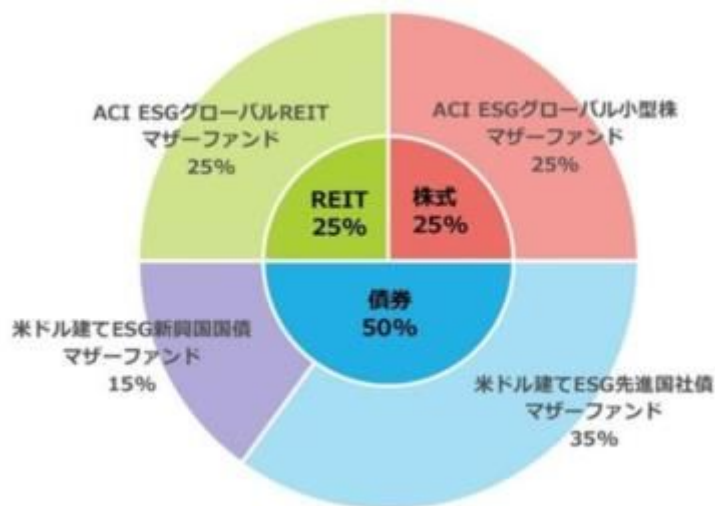
(1) 投資方針

< 更新後 >

「グローバルESGバランスファンド」は、分配頻度、為替ヘッジの有無の異なる、4本のファンドで構成されています。

各マザーファンドの運用にあたっては、ESG の観点から投資する銘柄を決定します。なお、各マザーファンドへの投資比率は以下を基本とします。

ESGとは、Environment（環境）、Social（社会）及びCorporate Governance（企業統治）の総称です。



「為替ヘッジあり」においては、実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジ（先進国通貨等による代替ヘッジを含みます。）により為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。ただし、代替ヘッジによっても為替変動リスクの低減の効果が小さいあるいは得られないと判断した通貨については、為替ヘッジを行わない場合があります。

「為替ヘッジなし」においては、実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

効率的な運用を行なうため、債券先物取引等のデリバティブ取引をヘッジ目的外の利用を含め実質的に活用する場合があります。

「ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド」について

- ・信託財産の成長を目標に積極的な運用を行なうことを基本とします。
- ・世界各国（新興国を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。
- ・組入銘柄の選定にあたっては、小型株のうち成長の持続性や株価バリュエーション等に着眼した分析で上位に位置する銘柄に対し、ESG等の観点も加えた綿密なファンダメンタルズ分析を行いません。
- ・効率的な運用を行なうため、ETFを活用する場合があります。
- ・株式の組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

「米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド」について

- ・インカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目的として運用を行なうことを基本とします。
- ・先進国の企業（金融機関を含みます。）が発行する米ドル建ての社債等（期限付劣後債、永久劣後債、優先証券（ハイブリッド証券）を含みます。）（「米ドル建て先進国社債等」といいます。）を主要投資対象とします。
- ・ポートフォリオの構築にあたっては、投資時点においてBBB格相当以上の格付（格付のない場合には委託会社が同等の信用度を有すると判断したものを含みます。）が付与されている米ドル建て先進国社債等の中から、環境問題への取り組み等に関する分析に基づき、クレジットアナリストによる定性評価、ESG評価、信用力、利回り水準等を勘案して投資対象銘柄を決定します。

格付は、S&P、Moody'sおよびFitchのいずれかの格付が付与されている場合、最も高い格付を基準とします。

- ・市場環境、流動性等を勘案して、米国国債等にも投資する場合があります。なお、米国国債等について

は、格付に関わらず投資を行なえるものとします。

- ・ポートフォリオの平均デュレーションは、原則として概ね6年～10年程度に維持することを基本とします。ただし、投資環境、資金動向、市況動向等を勘案し、委託会社が必要と判断した場合は、一時的に上記の範囲外となる場合があります。

投資対象となる公社債等のデュレーションには、初回コール償還日が存在する場合は、当該日付までのデュレーションを使用します。

- ・ポートフォリオの平均格付は、原則としてBBB格相当以上とします。
- ・銀行が発行する債券等への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

「米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド」について

- ・安定した収益の確保と信託財産の成長を図ることを目的として運用を行なうことを基本とします。
- ・米ドル建ての新興国国債等（国債、政府保証債、政府機関債等を含みます。）を主要投資対象とします。
- ・ポートフォリオの構築にあたっては、投資時点においてB格相当以上の格付（格付のない場合には委託会社が同等の信用度を有すると判断したものを含みます。）が付与されている米ドル建ての新興国国債等の中から、環境問題への取り組み等に関する分析に基づき、ファンダメンタルズ分析、ESG評価、信用力、利回り水準等を勘案して投資対象銘柄を決定します。

格付は、S&P、Moody'sのいずれかの格付が付与されている場合、最も高い格付を基準とします。

- ・市場環境、流動性等を勘案して、米国国債にも投資する場合があります。なお、米国国債については、格付に関わらず投資を行なえるものとします。
- ・ポートフォリオの平均デュレーションは、原則として概ね6年～10年程度に維持することを基本とします。ただし、投資環境、資金動向、市況動向等を勘案し、委託会社が必要と判断した場合は、一時的に上記の範囲外となる場合があります。
- ・ポートフォリオの平均格付は、原則としてB格相当以上とします。
- ・国債等の組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

「ACI ESGグローバルREIT マザーファンド」について

- ・高水準の配当収益の獲得と中長期的な値上がり益の獲得を目指して積極的な運用を行なうことを基本とします。
- ・世界各国（新興国を含みます。）の不動産関連有価証券を主要投資対象とします。
- ・REITへの投資にあたっては、サステナブル（持続的成長）テーマに着目し、成長力の高いグローバル・リートに投資を行ないます。
- ・組入銘柄の選定にあたっては、世界各投資対象地域の経済、為替相場、不動産市場の見通しに基づくトップダウン・アプローチによる各投資対象地域への配分と、配当水準、配当性向、配当成長を評価するための精緻なボトムアップ・アプローチによる個別銘柄選定を組み合わせるポートフォリオを構築します。個別銘柄の分析にあたってはESGの観点も加え、独自のESGテーマに沿う銘柄のみを投資候補銘柄とします。
- ・株式への投資にあたっては、REITが転換したもまたはその性質がREITに類するもの、あるいは不動産事業に関連するビジネスを行なっている企業の株式に限るものとします。
- ・効率的な運用を行なうため、不動産に関連するETFを活用する場合があります。
- ・REITの組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

「グローバルESGバランスファンド」を構成するファンド間でスイッチングができます。
（販売会社によっては、一部または全部のスイッチングのお取扱いを行わない場合があります。）

各マザーファンドの運用にあたっては、それぞれ以下の委託先に、運用の指図に関する権限の一部を委託します。

	ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド	ACI ESGグローバルREIT マザーファンド
委託する範囲	株式等の運用	不動産関連有価証券等の運用
委託先名称	アメリカン・センチュリー・インベストメント・マネジメント・インク (American Century Investment Management, Inc.)	
委託先所在地	米国 ミズーリ州 カンザスシティ市	

	米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド	米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド
委託する範囲	公社債等（ハイブリッド証券を含みます。）の運用	国債等の運用
委託先名称	ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド (NOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED)	
委託先所在地	英国 ロンドン市	

運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更する場合があります。

アメリカン・センチュリー・インベストメント・マネジメント・インクについて

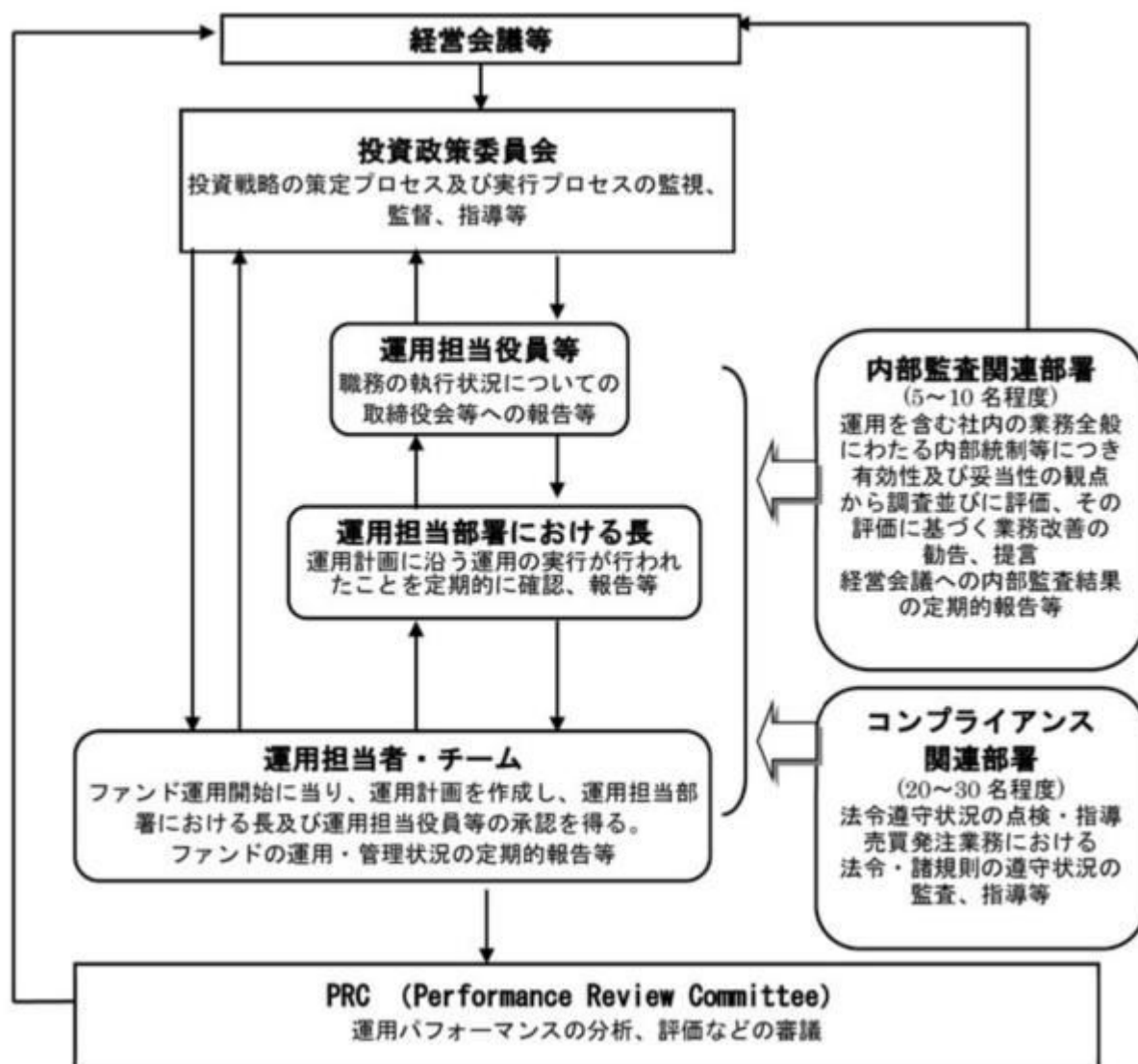
アメリカン・センチュリー・インベストメント・マネジメント・インクは、1958年にカンザスシティを本拠地として設立された運用会社です。長期的な視点でのアクティブ運用に定評があります。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 運用体制

< 更新後 >

ファンドを含む委託会社における投資信託の内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りです。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

当社では、「受託会社」または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

運用の外部委託を行う場合、「運用の外部委託先」に対しては、外部委託先が行った日々の約定について、投資ガイドラインに沿ったものであるかを確認しています。また、コンプライアンスレポートの提出を義務付け、定期的に管理状況に関する報告を受けています。さらに、外部委託先の管理体制、コンプライアンス体制等について調査ならびに評価を行い、定期的に商品に関する委員会に報告しています。

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（４）分配方針

< 訂正前 >

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

< 年2回決算型 >

収益分配金額は、上記 の範囲内で、原則として基準価額水準等を勘案し、委託者が決定します。

< 隔月分配型 >

収益分配金額は、上記 の範囲内で、委託者が決定するものとし、原則として、利子・配当等収益等を中心に分配を行なうことを基本とします。

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行ないます。

* 委託会社の判断により分配を行なわない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

ファンドの決算日

< 年2回決算型 >

原則として**毎年5月および11月の各18日**（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

初回決算日は、2021年5月18日となります。

< 隔月分配型 >

原則として**毎年1月、3月、5月、7月、9月および11月の各18日**（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

初回決算日は、2021年3月18日となります。

分配金に関する留意点

分配金は、預貯金の利息とは異なりファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後の純資産はその相当額が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。



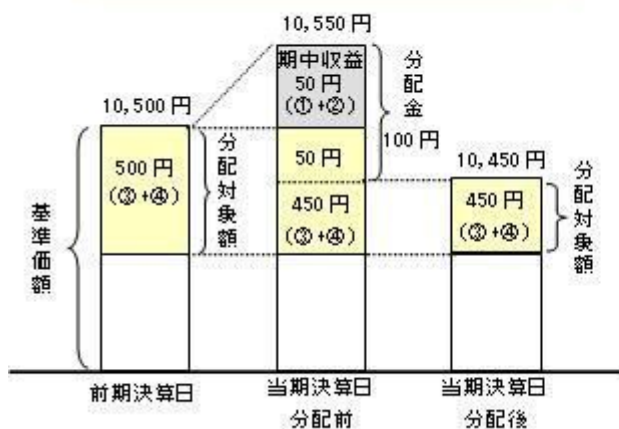
ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

・計算期間中に運用収益があった場合においても、当該運用収益を超えて分配を行なった場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

分配対象額とは、経費控除後の配当等収益 経費控除後の評価益を含む売買益 分配準備積立金 収益調整金です。

前期決算から基準価額が上昇した場合

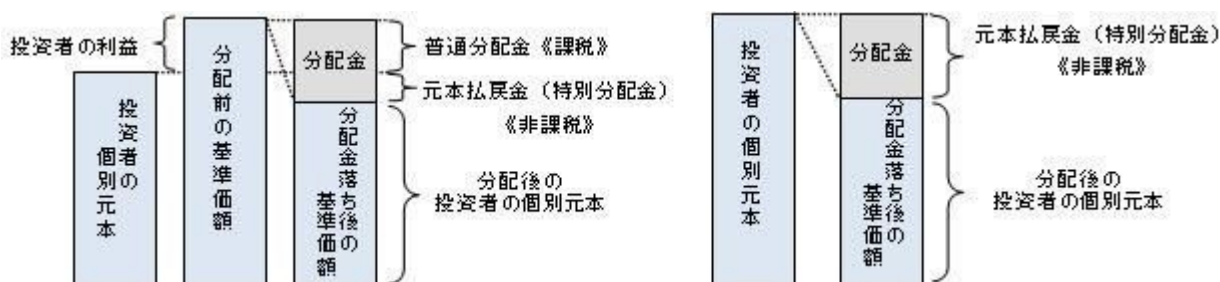


前期決算から基準価額が下落した場合



投資者の個別元本（追加型投資信託を保有する投資者毎の取得元本）の状況によっては、分配金額の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

普通分配金・・・	分配金落ち後の基準価額が投資者の個別元本と同額の場合または投資者の個別元本を上回っている場合には分配金の全額が普通分配金となります。
元本払戻金・・・ (特別分配金)	分配金落ち後の基準価額が投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となります。



投資者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、分配金発生時にその個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の投資者の個別元本となります。

（注）普通分配金に対する課税については、後述の「4 手数料等及び税金（5）課税上の取扱い」をご覧ください。

上記はイメージ図であり、実際の分配金額や基準価額について示唆、保証するものではありません。

< 訂正後 >

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

< 年2回決算型 >

収益分配金額は、上記の範囲内で、原則として基準価額水準等を勘案し、委託者が決定します。

< 隔月分配型 >

収益分配金額は、上記の範囲内で、委託者が決定するものとし、原則として、利子・配当等収益等を中心に分配を行なうことを基本とします。

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行いません。

* 委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

ファンドの決算日

< 年2回決算型 >

原則として毎年5月および11月の各18日（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

< 隔月分配型 >

原則として毎年1月、3月、5月、7月、9月および11月の各18日（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

◆分配金に関する留意点

●分配金は、預貯金の利息とは異なりファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後の純資産はその相当額が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。

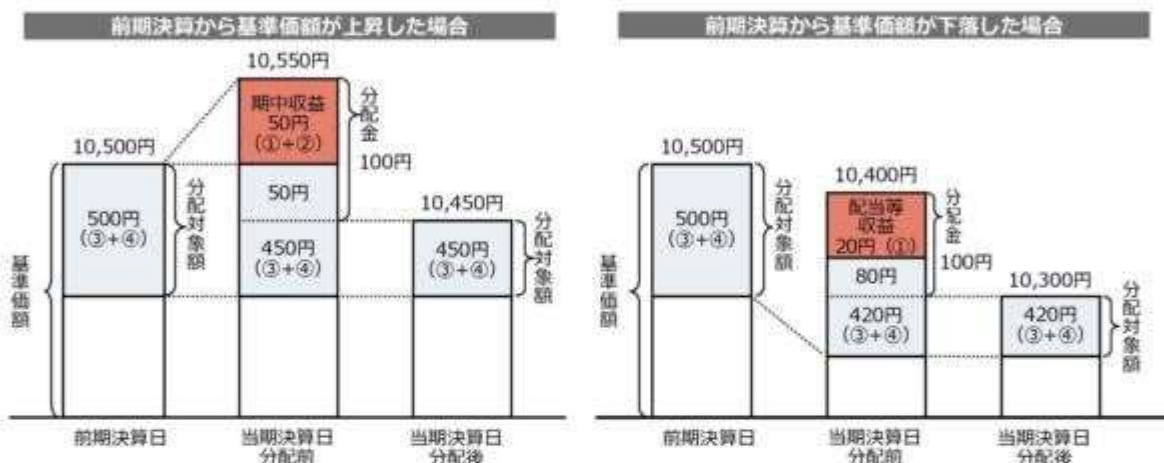


●ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

・計算期間中に運用収益があった場合においても、当該運用収益を超えて分配を行なった場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

※分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

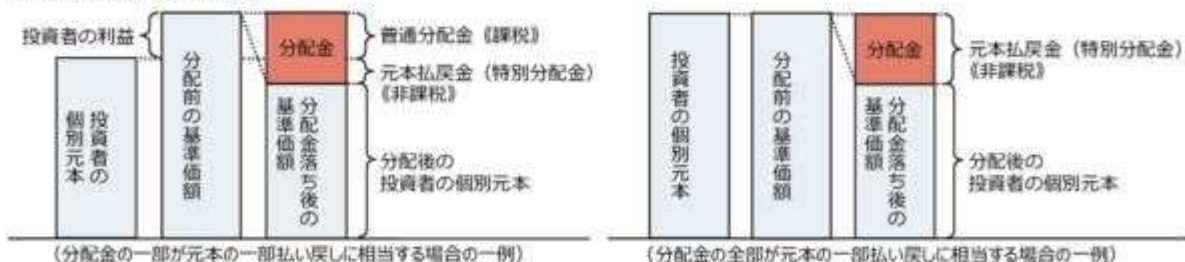
分配対象額とは、①経費控除後の配当等収益②経費控除後の評価益を含む売買益③分配準備積立金④収益調整金です。



●投資者の個別元本（追加型投資信託を保有する投資者毎の取得元本）の状況によっては、分配金額の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

普通分配金	分配金落ち後の基準価額が投資者の個別元本と同額の場合または投資者の個別元本を上回っている場合には分配金の全額が普通分配金となります。
元本払戻金 (特別分配金)	分配金落ち後の基準価額が投資者の個別元本を下回っている場合には、下回る部分の分配金の額が元本払戻金 (特別分配金) となります。

●投資者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、分配金発生時にその個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の投資者の個別元本となります。



分配金に関する留意点に記載の図はイメージ図であり、全ての状況について説明したものではありません。また、実際の分配金額や基準価額について示唆、保証するものではありません。

3 投資リスク

< 更新後 >

基準価額の変動要因

ファンドの基準価額は、投資を行なっている有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様に帰属します。

したがって、ファンドにおいて、投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金が割り込むことがあります。なお、投資信託は預貯金と異なります。

[株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式等に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。特に新興国の株式等の価格変動は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。またファンドは、小型株を中心に実質的に投資を行ないますので、株式市場全体の動きとファンドの基準価額の動きが大きく異なる場合があります。

[REITの価格変動リスク]

REITは、保有不動産の状況、市場金利の変動、不動産市況や株式市場の動向等により、価格が変動します。ファンドは実質的にREITに投資を行ないますので、これらの影響を受けます。特に新興国のREITの価格変動は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。また、モーゲージREITについては、組入れている不動産ローン担保証券等の価格変動や、組入れている証券を裏付けにしたレバレッジ運用の影響により、一般的なREITに比べ、価格が大きく変動する可能性が高いと想定されます。

[債券価格変動リスク]

債券（公社債等）は、市場金利や信用度の変動により価格が変動します。ファンドは実質的に債券に投資を行ないますので、これらの影響を受けます。特に新興国の債券価格の変動は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。また、ハイブリッド証券については、一般的に、繰上償還条項が設定されているため、発行体の企業業績、市況動向、制度変更等の事情により、価格が大きく変動する可能性が高いと想定されます。

[為替変動リスク]

「（為替ヘッジなし）年2回決算型」および「（為替ヘッジなし）隔月分配型」は、実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行ないませんので、為替変動の影響を受けます。特に新興国の通貨については、先進国の通貨に比べ流動性が低い状況となる可能性が高いこと等から、当該通貨の為替変動は先進国以上に大きいものになることも想定されます。

「（為替ヘッジあり）年2回決算型」および「（為替ヘッジあり）隔月分配型」は、実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本としますが、為替変動リスクを完全に排除できるわけではありません。なお、現地通貨による直接ヘッジのほか先進国通貨を用いた代替ヘッジを行なう場合がありますが、その場合、通貨間の値動きが異なる場合が想定され、十分な為替ヘッジ効果が得られないことがあります。また、円金利がヘッジ対象通貨の金利より低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかるため、基準価額の変動要因となります。なお、一部の通貨においては為替ヘッジの手段がない等の理由から為替ヘッジを行なわない場合があり、為替変動の影響を直接的に受けることとなります。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。

ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。

有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。

投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。また、ベビーファンドの換金等に伴ない、マザーファンドの換金を行なう場合には、原則として当該マザーファンドの信託財産に信託財産留保額を繰り入れます。

ファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国においては、政治、経済、社会情勢の変化が金融市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、当局による海外からの投資規制などが緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により、金融市場が著しい悪影響を被る可能性や運用上の制約を大きく受ける可能性があります。

上記のような投資環境変化の内容によっては、ファンドでの新規投資の中止や大幅な縮小をする場合があります。

ハイブリッド証券の弁済順位は、一般的に株式に優位し普通社債に劣後するため、発行体の破綻時における弁済順位が普通社債等優先される債務に対して後順位となります。

ハイブリッド証券には、設定された繰上償還が実施されなかった場合に利息や配当が変動になる性質を持つもの等があり、ファンドはそれらにも投資を行ないます。

今後、ハイブリッド証券市場において制度変更や新たな規制の導入がある場合には、対象市場が著しく縮小する可能性があります。

上記のような投資環境変化の内容によっては、ファンドでの新規投資の中止や大幅な縮小をする場合があります。

ファンドは、大型株に比べ相対的に市場の流動性が低い小型株を中心に実質的に投資を行ないますので、ファンドに大量の資金変動が生じた場合等には機動的に証券を売買できない場合があります。

ファンドが実質的な投資対象とするREITの中には、流動性の低いものもあり、こうしたREITへの投資は、流動性の高い株式等に比べて制約を受けることが想定されます。

REITに関する法律（税制度、会計制度等）、不動産を取り巻く規制が変更となった場合、REITの価格や配当に影響が及ぶことが想定されます。

金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、投資信託約款の規定に従い、委託会社の判断でファンドの購入（スイッチングによる購入を含みます。）・換金の各受付けを中止すること、および既に受付けた購入（スイッチングによる購入を含みます。）・換金の各受付けを取り消す場合があります。

■ リスクの定量的比較 (2016年7月末～2021年6月末：月次)

Ⅰ (為替ヘッジあり) 年2回決算型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	—	42.1	59.8	62.7	8.0	11.4	19.3
最小値 (%)	—	△ 18.6	△ 16.9	△ 19.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 12.9
平均値 (%)	—	7.5	12.0	11.5	0.7	2.0	3.1

* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
* 年間騰落率は、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。

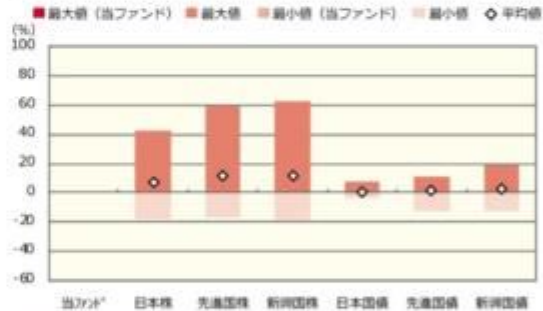
* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
* 2016年7月から2021年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
* 決算日に対応した数値とは異なります。

Ⅱ (為替ヘッジなし) 年2回決算型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	—	42.1	59.8	62.7	8.0	11.4	19.3
最小値 (%)	—	△ 18.6	△ 16.9	△ 19.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 12.9
平均値 (%)	—	7.5	12.0	11.5	0.7	2.0	3.1

* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
* 年間騰落率は、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。

* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
* 2016年7月から2021年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
* 決算日に対応した数値とは異なります。

Ⅰ（為替ヘッジあり）隔月分配型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	—	42.1	59.8	62.7	8.0	11.4	19.3
最小値 (%)	—	△ 18.6	△ 16.9	△ 19.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 12.9
平均値 (%)	—	7.5	12.0	11.5	0.7	2.0	3.1

* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
* 年間騰落率は、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。

* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
* 2016年7月から2021年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
* 決算日に対応した数値とは異なります。

Ⅰ（為替ヘッジなし）隔月分配型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	—	42.1	59.8	62.7	8.0	11.4	19.3
最小値 (%)	—	△ 18.6	△ 16.9	△ 19.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 12.9
平均値 (%)	—	7.5	12.0	11.5	0.7	2.0	3.1

* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
* 年間騰落率は、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。

* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
* 2016年7月から2021年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
* 決算日に対応した数値とは異なります。

※ 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

<p><代表的な資産クラスの指数></p> <ul style="list-style-type: none"> ○日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み） ○先進国株：MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース） ○新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース） ○日本国債：NOMURA-BPI 国債 ○先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） ○新興国債：JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）
<p>■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■</p> <ul style="list-style-type: none"> ○東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。 ○MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。 ○NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。 ○FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。 ○JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。 <p>米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSEC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての推奨、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSEC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC., またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。</p> <p style="text-align: right;">（出所：株式会社野村総合研究所、FTSE Fixed Income LLC 他）</p>

4 手数料等及び税金

（５）課税上の取扱い

< 更新後 >

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（国税（所得税及び復興特別所得税）15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。

なお、配当控除は適用されません。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により20.315%（国税15.315%および地方税5%）の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は20.315%の税率により源泉徴収が行なわれます。

損益通算について

以下の所得間で損益通算が可能です。上場株式等の配当所得については申告分離課税を選択したものに限りです。

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 ^{（注2）}	《配当所得》
--------	---------------------------------	--------

・ 特定公社債 ^(注1) の利子 ・ 公募公社債投資信託の収益分配金	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の ・ 譲渡益 ・ 譲渡損	・ 上場株式の配当 ・ 公募株式投資信託の収益分配金
--	--	-------------------------------

(注1)「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、2015年12月31日以前に発行された公社債（同族会社が発行した社債を除きます。）などの一定の公社債をいいます。

(注2)株式等に係る譲渡所得等について、上場株式等に係る譲渡所得等とそれ以外の株式等に係る譲渡所得等に区分し、別々の分離課税制度とすることとされ、原則として、これら相互の通算等ができないこととされました。

上場株式、公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の投資家に対する課税

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（国税15.315%）の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金（解約）時および償還時の課税について

[個人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の差益 については、譲渡所得とみなして課税が行われます。

換金（解約）時および償還時の価額から取得費（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益を譲渡益として課税対象となります。

[法人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が源泉徴収の対象（配当所得）となります。

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

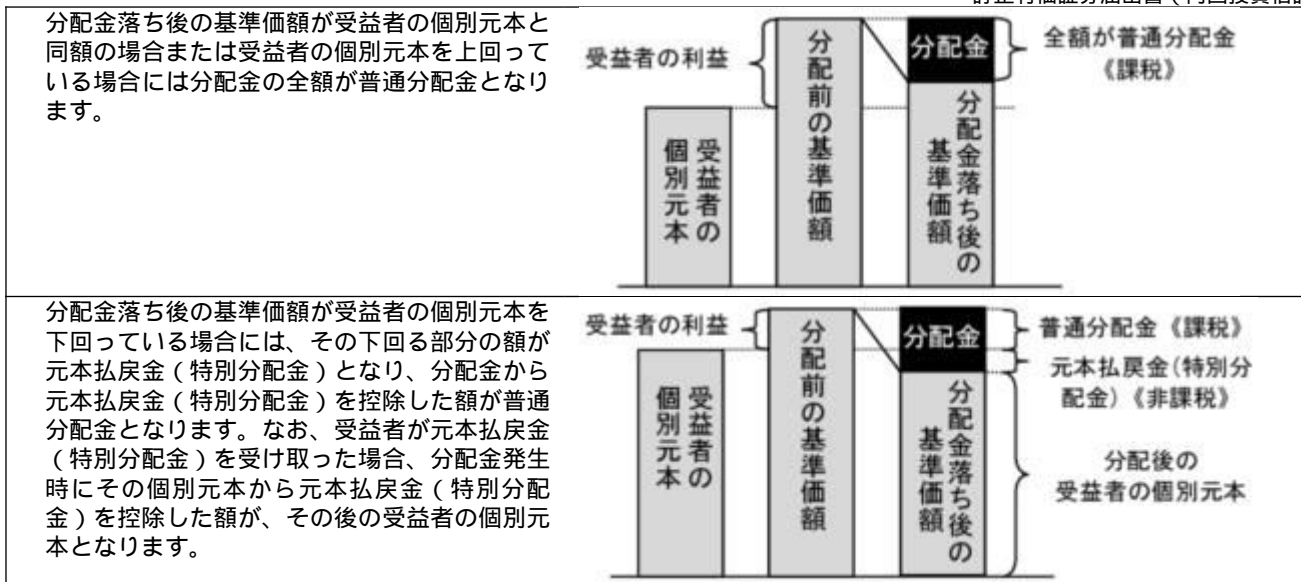
個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合や受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合などには、当該受益者の個別元本が変わりますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

分配金の課税について

分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）があります。



上図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

- * 外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- * 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2021年6月末現在）が変更になる場合があります。

5 運用状況

以下は2021年6月30日現在の運用状況であります。

また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	7,307,412,964	98.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）		81,012,211	1.09
合計（純資産総額）		7,388,425,175	100.00

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	31,298,584,046	98.92
現金・預金・その他資産（負債控除後）		340,254,596	1.07
合計（純資産総額）		31,638,838,642	100.00

グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	781,659,633	98.97
現金・預金・その他資産（負債控除後）		8,122,686	1.02
合計（純資産総額）		789,782,319	100.00

グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	2,328,522,956	98.99
現金・預金・その他資産（負債控除後）		23,561,552	1.00
合計（純資産総額）		2,352,084,508	100.00

（参考）A C I E S Gグローバル小型株 マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	709,559,000	6.80
	アメリカ	5,798,275,073	55.63
	カナダ	714,963,108	6.86
	ブラジル	155,374,193	1.49
	ドイツ	75,560,920	0.72
	イタリア	13,473,750	0.12
	フランス	79,776,401	0.76
	オランダ	188,276,987	1.80
	ベルギー	162,867,448	1.56
	フィンランド	131,326,209	1.26
	イギリス	529,561,039	5.08
	スイス	117,341,398	1.12
	スウェーデン	235,008,507	2.25
	ノルウェー	99,828,330	0.95
	デンマーク	140,225,177	1.34
	オーストラリア	166,578,738	1.59
	香港	96,910,320	0.92
韓国	87,672,477	0.84	
台湾	136,440,948	1.30	
小計		9,639,020,023	92.49
投資信託受益証券	アメリカ	2,310,845	0.02
投資証券	アメリカ	318,097,165	3.05
現金・預金・その他資産（負債控除後）		462,253,508	4.43

合計(純資産総額)	10,421,681,541	100.00
-----------	----------------	--------

(参考)米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アメリカ	14,234,838,733	97.38
現金・預金・その他資産(負債控除後)		381,975,451	2.61
合計(純資産総額)		14,616,814,184	100.00

(参考)米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	4,381,583,951	69.91
特殊債券	アメリカ	606,396,077	9.67
社債券	アメリカ	977,506,634	15.59
現金・預金・その他資産(負債控除後)		301,358,780	4.80
合計(純資産総額)		6,266,845,442	100.00

(参考)ACI ESGグローバルREIT マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	211,928,000	2.03
	アメリカ	101,212,646	0.97
	カナダ	101,204,451	0.97
	オランダ	95,842,674	0.92
	スペイン	99,101,098	0.95
	ベルギー	48,300,176	0.46
	イギリス	69,532,377	0.66
	香港	83,201,187	0.79
	小計	810,322,609	7.78
投資証券	日本	605,635,300	5.81
	アメリカ	6,801,184,955	65.32
	カナダ	154,960,328	1.48
	フランス	125,887,105	1.20
	イギリス	429,709,189	4.12
	オーストラリア	597,825,669	5.74
	香港	202,353,888	1.94
	シンガポール	203,010,979	1.94
	小計	9,120,567,413	87.59
現金・預金・その他資産(負債控除後)		480,978,758	4.61

合計(純資産総額)	10,411,868,780	100.00
-----------	----------------	--------

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	米ドル建てESG先進国社債マザーファンド	2,429,600,096	1.0211	2,480,965,038	1.0538	2,560,312,581	34.65
2	日本	親投資信託受益証券	ACI ESGグローバル小型株マザーファンド	1,421,858,911	1.2348	1,755,777,325	1.2839	1,825,524,655	24.70
3	日本	親投資信託受益証券	ACI ESGグローバルREITマザーファンド	1,412,169,417	1.2086	1,706,818,879	1.2915	1,823,816,802	24.68
4	日本	親投資信託受益証券	米ドル建てESG新興国国債マザーファンド	1,042,605,116	1.0288	1,072,723,000	1.0529	1,097,758,926	14.85

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.90
合計	98.90

グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジなし)年2回決算型

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	米ドル建てESG先進国社債マザーファンド	10,406,057,615	1.0255	10,671,547,005	1.0538	10,965,903,514	34.65
2	日本	親投資信託受益証券	ACI ESGグローバル小型株マザーファンド	6,090,024,857	1.2404	7,554,638,867	1.2839	7,818,982,913	24.71
3	日本	親投資信託受益証券	ACI ESGグローバルREITマザーファンド	6,048,704,090	1.2219	7,391,128,312	1.2915	7,811,901,332	24.69
4	日本	親投資信託受益証券	米ドル建てESG新興国国債マザーファンド	4,465,567,753	1.0317	4,607,547,251	1.0529	4,701,796,287	14.86

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.92
合計	98.92

グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジあり)隔月分配型

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てESG先進国社債マ ザーファンド	260,260,642	1.0206	265,631,576	1.0538	274,262,664	34.72
2	日本	親投資信託 受益証券	ACI ESGグローバル小型 株 マザーファンド	151,954,322	1.2345	187,599,918	1.2839	195,094,154	24.70
3	日本	親投資信託 受益証券	ACI ESGグローバルREI T マザーファンド	150,916,880	1.2060	182,010,270	1.2915	194,909,150	24.67
4	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てESG新興国国債マ ザーファンド	111,495,551	1.0283	114,659,781	1.0529	117,393,665	14.86

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.97
合計	98.97

グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジなし)隔月分配型

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てESG先進国社債マ ザーファンド	774,188,761	1.0254	793,916,912	1.0538	815,840,116	34.68
2	日本	親投資信託 受益証券	ACI ESGグローバル小型 株 マザーファンド	453,076,097	1.2413	562,422,168	1.2839	581,704,400	24.73
3	日本	親投資信託 受益証券	ACI ESGグローバルREI T マザーファンド	449,997,453	1.2228	550,260,699	1.2915	581,171,710	24.70
4	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てESG新興国国債マ ザーファンド	332,231,675	1.0319	342,841,327	1.0529	349,806,730	14.87

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.99
合計	98.99

(参考) ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	WINTRUST FINANCIAL CORP	銀行	18,800	8,109.71	152,462,692	8,327.77	156,562,260	1.50

2	アメリカ	株式	RADNET INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	38,817	2,575.82	99,985,986	3,692.26	143,322,697	1.37
3	アメリカ	株式	NOVA MEASURING INSTRUMENTS	半導体・半導体製造装置	12,410	9,455.57	117,343,624	11,433.97	141,895,593	1.36
4	デンマーク	株式	PANDORA A/S	繊維・アパレル・贅沢品	9,316	12,828.25	119,507,995	15,052.07	140,225,177	1.34
5	カナダ	株式	CAPSTONE MINING CORP	金属・鉱業	286,777	332.78	95,435,010	459.12	131,665,773	1.26
6	フィンランド	株式	METSO OUTOTEC OYJ	機械	101,430	1,192.89	120,995,633	1,294.74	131,326,209	1.26
7	カナダ	株式	ECN CAPITAL CORP	各種金融サービス	151,713	693.67	105,239,029	821.96	124,702,473	1.19
8	アメリカ	投資証券	GLOBAL MEDICAL REIT INC		76,016	1,581.58	120,225,613	1,624.42	123,481,925	1.18
9	アメリカ	株式	OPEN LENDING CORP - CL A	資本市場	26,777	4,165.47	111,538,932	4,576.90	122,555,817	1.17
10	イギリス	株式	ELECTROCOMPONENTS PLC	商社・流通業	74,617	1,503.44	112,182,199	1,589.80	118,626,166	1.13
11	アメリカ	投資証券	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES		13,398	8,424.70	112,874,229	8,691.58	116,449,896	1.11
12	アメリカ	株式	CROCS INC	繊維・アパレル・贅沢品	9,095	9,279.98	84,401,494	12,788.57	116,312,108	1.11
13	アメリカ	株式	JABIL INC	電子装置・機器・部品	17,635	5,442.33	95,975,664	6,451.23	113,767,568	1.09
14	アメリカ	株式	CAPRI HOLDINGS LTD	繊維・アパレル・贅沢品	18,902	5,395.62	101,988,015	5,996.75	113,350,633	1.08
15	アメリカ	株式	CLEAN HARBORS INC	商業サービス・用品	11,178	9,786.30	109,391,330	10,032.92	112,148,018	1.07
16	アメリカ	株式	GLACIER BANCORP INC	銀行	18,407	6,548.47	120,537,819	6,091.85	112,132,723	1.07
17	アメリカ	株式	SUMMIT MATERIALS INC -CL A	建設資材	28,971	3,178.07	92,071,977	3,866.98	112,030,353	1.07
18	アメリカ	株式	KORNIT DIGITAL LTD	機械	8,041	11,113.50	89,363,715	13,755.04	110,604,327	1.06

19	アメリカ	株式	R1 RCM INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	44,607	2,709.79	120,875,674	2,446.02	109,110,042	1.04
20	アメリカ	株式	AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	専門小売り	26,524	3,273.69	86,831,547	4,106.94	108,932,508	1.04
21	アメリカ	株式	FOX FACTORY HOLDING CORP	自動車部品	6,231	14,515.55	90,446,415	17,311.29	107,866,704	1.03
22	アメリカ	株式	SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	航空宇宙・防衛	21,006	5,068.98	106,479,145	5,130.91	107,779,937	1.03
23	台湾	株式	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	機械	24,000	3,987.39	95,697,494	4,377.67	105,064,284	1.00
24	イギリス	株式	HOWDEN JOINERY GROUP PLC	商社・流通業	81,661	1,162.40	94,922,834	1,264.48	103,259,432	0.99
25	アメリカ	株式	ORTHO CLINICAL DIAGNOSTICS H	ヘルスケア機器・用品	42,969	2,151.97	92,468,339	2,392.95	102,822,720	0.98
26	カナダ	株式	COLLIERS INTERNATIONAL GROUP	不動産管理・開発	8,004	11,579.17	92,679,749	12,589.76	100,768,463	0.96
27	オランダ	株式	APERAM	金属・鉱業	17,404	5,801.08	100,962,117	5,740.83	99,913,499	0.95
28	ベルギー	株式	D' IETEREN GROUP	販売	7,348	11,753.91	86,367,790	13,592.21	99,875,589	0.95
29	ノルウェー	株式	BAKKAFROST P/F	食品	10,942	8,648.18	94,628,484	9,123.40	99,828,330	0.95
30	アメリカ	株式	RH	専門小売り	1,302	62,632.76	81,547,864	76,274.76	99,309,746	0.95

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	化学	0.69
		機械	0.72
		その他製品	0.68
		陸運業	0.46
		情報・通信業	0.41
		小売業	2.20
		不動産業	0.76
		サービス業	0.85
	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.30

メディア	1.18
娯楽	0.46
不動産管理・開発	2.49
石油・ガス・消耗燃料	0.90
化学	3.19
建設資材	1.79
容器・包装	0.51
金属・鉱業	3.29
航空宇宙・防衛	1.03
建設関連製品	1.34
電気設備	0.62
コングロマリット	0.84
機械	5.43
商社・流通業	2.65
商業サービス・用品	1.91
旅客航空輸送業	0.26
陸運・鉄道	1.38
運送インフラ	0.25
自動車部品	1.03
家庭用耐久財	0.77
レジャー用品	2.34
繊維・アパレル・贅沢品	4.94
ホテル・レストラン・レジャー	3.66
販売	0.95
インターネット販売・通信販売	0.58
専門小売り	5.31
飲料	0.95
食品	0.95
パーソナル用品	0.91
ヘルスケア機器・用品	2.90
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	3.58
バイオテクノロジー	0.77
銀行	4.03
各種金融サービス	1.19
保険	1.53
情報技術サービス	3.71

		ソフトウェア	2.42
		通信機器	0.30
		電子装置・機器・部品	1.94
		半導体・半導体製造装置	5.99
		資本市場	1.90
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.37
		ヘルスケア・テクノロジー	0.33
		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.49
		専門サービス	1.78
	投資信託受益証券		0.02
	投資証券		3.05
	合 計		95.56

(参考) 米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	社債券	CNH INDUSTRIAL CAPITAL L	3,700,000	12,474.66	461,562,524	12,263.98	453,767,504	3.85	2027/11/15	3.10
2	アメリカ	社債券	HEALTHPEAK PROPERTIES	3,800,000	11,627.74	441,854,347	11,570.94	439,695,877	2.875	2031/1/15	3.00
3	アメリカ	社債券	HP INC	3,700,000	11,914.18	440,824,815	11,808.04	436,897,514	3.4	2030/6/17	2.98
4	アメリカ	社債券	RALPH LAUREN CORP	3,700,000	11,716.88	433,524,909	11,750.44	434,766,313	2.95	2030/6/15	2.97
5	アメリカ	社債券	NXP BV/NXP FDG/NXP USA	3,600,000	12,107.18	435,858,678	12,072.05	434,594,103	3.4	2030/5/1	2.97
6	アメリカ	社債券	STARBUCKS CORP	3,800,000	11,491.52	436,677,877	11,428.54	434,284,742	2.55	2030/11/15	2.97
7	アメリカ	社債券	FEDEX CORP	3,400,000	12,449.85	423,295,044	12,668.97	430,745,030	4.05	2048/2/15	2.94
8	アメリカ	社債券	NEXTERA ENERGY CAPITAL	3,800,000	11,212.15	426,061,953	11,138.63	423,267,959	2.25	2030/6/1	2.89
9	アメリカ	社債券	ENEL FINANCE INTL NV	3,100,000	13,430.64	416,350,066	13,201.01	409,231,533	4.875	2029/6/14	2.79
10	アメリカ	社債券	BEST BUY CO INC	3,200,000	12,935.25	413,928,054	12,783.39	409,068,505	4.45	2028/10/1	2.79
11	アメリカ	社債券	WALGREENS BOOTS ALLIANCE	3,450,000	11,870.45	409,530,653	11,818.04	407,722,441	3.2	2030/4/15	2.78
12	アメリカ	社債券	CMS ENERGY CORP	3,300,000	12,343.35	407,330,873	12,220.19	403,266,461	4.75	2050/6/1	2.75
13	アメリカ	社債券	E.ON INTL FINANCE BV	2,400,000	16,002.11	384,050,643	16,070.83	385,699,979	6.65	2038/4/30	2.63
14	アメリカ	社債券	INGERSOLL-RAND LUX FINAN	3,000,000	12,352.92	370,587,858	12,463.95	373,918,617	3.8	2029/3/21	2.55
15	アメリカ	社債券	AVANGRID INC	3,000,000	12,553.04	376,591,469	12,428.83	372,865,045	3.8	2029/6/1	2.55
16	アメリカ	社債券	JABIL INC	3,050,000	12,017.51	366,534,196	11,966.89	364,990,420	3.6	2030/1/15	2.49
17	アメリカ	社債券	AES CORP/THE	3,000,000	12,290.94	368,728,224	12,096.84	362,905,314	3.95	2030/7/15	2.48
18	アメリカ	社債券	ASHTREAD CAPITAL INC	3,100,000	11,751.40	364,293,453	11,666.19	361,651,890	4	2028/5/1	2.47
19	アメリカ	社債券	RAYTHEON TECH CORP	3,100,000	11,293.61	350,102,141	11,354.66	351,994,756	3.125	2050/7/1	2.40

20	アメリカ	社債券	DOMINION ENERGY INC	2,950,000	11,688.29	344,804,612	11,776.77	347,414,715	4.65	2099/12/13	2.37
21	アメリカ	社債券	DELL INT LLC / EMC CORP	2,550,000	13,622.42	347,371,843	13,536.25	345,174,610	6.1	2027/7/15	2.36
22	アメリカ	社債券	WEA FINANCE LLC/WESTFIEL	2,900,000	11,751.74	340,800,538	11,850.14	343,654,216	3.75	2024/9/17	2.35
23	アメリカ	社債券	WELLTOWER INC	3,000,000	11,449.81	343,494,543	11,388.49	341,654,713	2.75	2031/1/15	2.33
24	アメリカ	社債券	MCDONALD'S CORP	2,700,000	12,226.99	330,128,960	12,425.32	335,483,745	3.6	2030/7/1	2.29
25	アメリカ	社債券	VENTAS REALTY LP/CAP CRP	2,600,000	12,753.92	331,601,995	12,711.45	330,497,718	4.4	2029/1/15	2.26
26	アメリカ	社債券	ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	2,300,000	12,839.59	295,310,636	13,434.58	308,995,464	4.5	2050/6/1	2.11
27	アメリカ	社債券	SSE PLC	2,500,000	11,526.18	288,154,727	11,477.61	286,940,448	4.75	2077/9/16	1.96
28	アメリカ	社債券	HASBRO INC	2,250,000	12,143.45	273,227,808	12,291.03	276,548,300	3.9	2029/11/19	1.89
29	アメリカ	社債券	SYSCO CORPORATION	1,862,000	14,108.27	262,696,017	14,176.15	263,960,022	5.95	2030/4/1	1.80
30	アメリカ	社債券	INTL FLAVOR & FRAGRANCES	2,200,000	11,215.14	246,733,172	11,339.76	249,474,938	3.268	2040/11/15	1.70

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	97.38
合計	97.38

(参考)米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	アメリカ	社債券	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO	1,860,000	13,321.97	247,788,659	13,251.44	246,476,835	5.375	2030/4/24	3.93
2	アメリカ	国債証券	KINGDOM OF BAHRAIN	1,940,000	12,781.98	247,970,471	12,613.03	244,692,803	7	2026/1/26	3.90
3	アメリカ	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,820,000	13,185.77	239,981,136	13,149.06	239,313,035	4.125	2047/10/11	3.81
4	アメリカ	国債証券	PANAMA GLOBAL	1,460,000	15,602.43	227,795,486	15,296.53	223,329,359	8.875	2027/9/30	3.56
5	アメリカ	国債証券	STATE OF QATAR	1,440,000	15,610.23	224,787,335	15,425.79	222,131,513	5.75	2042/1/20	3.54
6	アメリカ	特殊債券	PETROLIAM NASIONAL BERHD	1,510,000	14,917.92	225,260,660	14,446.27	218,138,721	7.625	2026/10/15	3.48
7	アメリカ	国債証券	MEXICO GLOBAL	1,450,000	14,948.61	216,754,913	14,774.26	214,226,800	6.75	2034/9/27	3.41
8	アメリカ	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	1,820,000	11,490.41	209,125,579	11,550.08	210,211,474	4.875	2025/2/1	3.35
9	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,620,000	11,949.28	193,578,362	11,879.94	192,455,046	4.5	2029/5/30	3.07
10	アメリカ	国債証券	PERU GLOBAL	1,230,000	15,965.09	196,370,729	15,197.06	186,923,895	6.55	2037/3/14	2.98
11	アメリカ	社債券	PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR	1,400,000	12,837.84	179,729,876	12,880.85	180,331,984	5.375	2029/1/25	2.87
12	アメリカ	国債証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	1,300,000	12,890.68	167,578,903	12,772.10	166,037,307	4.375	2027/10/27	2.64
13	アメリカ	国債証券	COLOMBIA GLOBAL	1,090,000	15,583.21	169,857,074	14,584.83	158,974,740	7.375	2037/9/18	2.53
14	アメリカ	国債証券	INDONESIA GLOBAL	950,000	15,240.11	144,781,068	15,247.03	144,846,841	6.625	2037/2/17	2.31
15	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	1,220,000	11,479.65	140,051,781	11,356.67	138,551,454	2.844	2030/6/20	2.21

16	アメリカ	特殊債券	BANCO CENTRAL COSTA RICA	1,200,000	10,739.10	128,869,269	11,453.43	137,441,209	4.375	2025/4/30	2.19
17	アメリカ	国債証券	CHINA GOVT INTL BOND	1,200,000	10,526.88	126,322,656	10,672.47	128,069,647	1.2	2030/10/21	2.04
18	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,000,000	12,255.11	122,551,170	12,090.26	120,902,644	4.5	2029/3/15	1.92
19	アメリカ	社債券	CODELCO INC	1,000,000	11,957.45	119,574,578	12,071.04	120,710,400	3.75	2031/1/15	1.92
20	アメリカ	国債証券	INDONESIA GLOBAL	680,000	17,796.25	121,014,550	17,706.72	120,405,762	8.5	2035/10/12	1.92
21	アメリカ	社債券	PETROLEOS MEXICANOS	1,000,000	11,379.67	113,796,772	11,414.62	114,146,205	6.5	2029/1/23	1.82
22	アメリカ	社債券	CODELCO INC	760,000	14,931.91	113,482,526	14,508.63	110,265,639	5.625	2035/9/21	1.75
23	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	840,000	12,041.95	101,152,391	12,216.43	102,618,063	3.86	2047/6/21	1.63
24	アメリカ	国債証券	KINGDOM OF BAHRAIN	800,000	12,475.02	99,800,219	12,517.84	100,142,752	7.375	2030/5/14	1.59
25	アメリカ	国債証券	ROMANIA	850,000	11,768.68	100,033,809	11,456.64	97,381,448	3	2031/2/14	1.55
26	アメリカ	特殊債券	EXPORT IMPORT BANK CHINA	800,000	12,112.54	96,900,370	12,052.61	96,420,930	3.625	2024/7/31	1.53
27	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	800,000	11,776.13	94,209,073	11,773.67	94,189,389	3.875	2027/4/25	1.50
28	アメリカ	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	800,000	11,511.04	92,088,371	11,494.56	91,956,559	4.75	2026/6/15	1.46
29	アメリカ	社債券	PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR	800,000	11,238.07	89,904,636	11,088.40	88,707,276	3	2030/6/30	1.41
30	アメリカ	国債証券	STATE OF QATAR	600,000	14,426.45	86,558,706	14,643.55	87,861,339	5.103	2048/4/23	1.40

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	69.91
特殊債券	9.67
社債券	15.59
合計	95.19

(参考) ACI ESGグローバルREIT マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
1	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	61,618	12,113.27	746,395,541	13,429.94	827,526,105	7.94
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	5,918	80,440.31	476,045,785	88,721.65	525,054,733	5.04
3	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	32,486	12,279.54	398,913,157	14,484.87	470,555,623	4.51
4	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	105,886	3,537.46	374,568,190	4,148.96	439,316,948	4.21
5	アメリカ	投資証券	UDR INC	72,700	4,818.86	350,331,376	5,470.39	397,697,542	3.81
6	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	40,562	8,093.53	328,289,842	9,223.47	374,122,706	3.59
7	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	17,519	14,902.87	261,083,487	18,204.78	318,929,635	3.06
8	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	170,314	1,532.02	260,925,158	1,767.13	300,967,183	2.89
9	アメリカ	投資証券	LIFE STORAGE INC	24,083	9,820.54	236,508,271	11,893.98	286,442,836	2.75
10	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	31,421	7,662.88	240,775,414	8,576.58	269,484,871	2.58
11	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	33,784	7,514.97	253,886,034	7,513.91	253,849,969	2.43
12	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	11,971	17,231.91	206,283,289	19,075.05	228,347,424	2.19

13	香港	投資証券	LINK REIT	187,100	1,023.52	191,501,862	1,081.52	202,353,888	1.94
14	アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	21,829	8,579.74	187,287,207	8,903.90	194,363,268	1.86
15	アメリカ	投資証券	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	8,746	20,631.70	180,444,901	21,451.41	187,614,069	1.80
16	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	53,109	3,091.45	164,184,289	3,432.40	182,291,502	1.75
17	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	100,643	1,486.32	149,588,639	1,693.18	170,407,096	1.63
18	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,037	29,579.65	148,992,741	33,409.53	168,283,830	1.61
19	アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	25,423	5,859.40	148,963,740	6,400.37	162,716,617	1.56
20	アメリカ	投資証券	KILROY REALTY CORP	20,662	7,522.14	155,422,507	7,721.80	159,547,860	1.53
21	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	24,615	5,808.48	142,975,790	6,399.26	157,517,898	1.51
22	オーストラリア	投資証券	CHARTER HALL GROUP	110,499	1,145.16	126,539,110	1,305.81	144,291,274	1.38
23	アメリカ	投資証券	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	56,654	2,248.04	127,360,487	2,544.44	144,153,032	1.38
24	日本	投資証券	S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	901	134,464	121,152,253	157,600	141,997,600	1.36
25	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	30,105	4,209.24	126,719,196	4,679.74	140,883,741	1.35
26	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	61,188	2,320.43	141,982,576	2,300.06	140,736,316	1.35
27	アメリカ	投資証券	XENIA HOTELS & RESORTS INC	65,740	2,262.61	148,744,550	2,049.04	134,704,376	1.29
28	シンガポール	投資証券	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	743,700	171.39	127,469,236	175.86	130,790,949	1.25
29	フランス	投資証券	KLEPIERRE	44,603	2,637.24	117,629,136	2,822.39	125,887,105	1.20
30	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	586	184,297	107,998,335	213,800	125,286,800	1.20

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)	
株式	国内	不動産業	2.03	
		国外	不動産管理・開発	2.35
			家庭用耐久財	0.66
			ホテル・レストラン・レジャー	0.97
			情報技術サービス	0.79
			各種電気通信サービス	0.95
投資証券			87.59	
合計			95.38	

投資不動産物件

グローバル E S G バランスファンド (為替ヘッジあり) 年 2 回決算型

該当事項はありません。

グローバル E S G バランスファンド (為替ヘッジなし) 年 2 回決算型

該当事項はありません。

グローバル E S G バランスファンド (為替ヘッジあり) 隔月分配型

該当事項はありません。

グローバル E S G バランスファンド (為替ヘッジなし) 隔月分配型

該当事項はありません。

（参考）A C I E S Gグローバル小型株 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）米ドル建てE S G先進国社債 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）米ドル建てE S G新興国国債 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）A C I E S GグローバルR E I T マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

該当事項はありません。

グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

該当事項はありません。

グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型

該当事項はありません。

グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型

該当事項はありません。

（参考）A C I E S Gグローバル小型株 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）米ドル建てE S G先進国社債 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）米ドル建てE S G新興国国債 マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) A C I E S G グローバル R E I T マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

グローバル E S G バランスファンド（為替ヘッジあり）年 2 回決算型

2021年6月末日及び同日前1年以内における各月末（設定来）並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）	1口当たり純資産額(円)		
		（分配落）	（分配付）	
第1計算期間 (2021年 5月18日)	6,440	6,446	1.0472	1.0482
2020年11月末日	888		1.0000	
12月末日	2,059		1.0170	
2021年 1月末日	3,157		1.0243	
2月末日	4,121		1.0307	
3月末日	5,571		1.0270	
4月末日	6,335		1.0611	
5月末日	6,768		1.0631	
6月末日	7,388		1.0812	

グローバル E S G バランスファンド（為替ヘッジなし）年 2 回決算型

2021年6月末日及び同日前1年以内における各月末（設定来）並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）	1口当たり純資産額(円)		
		（分配落）	（分配付）	
第1計算期間 (2021年 5月18日)	21,698	21,718	1.1032	1.1042
2020年11月末日	1,166		1.0000	
12月末日	3,233		1.0163	
2021年 1月末日	5,741		1.0326	
2月末日	9,455		1.0566	

3月末日	15,283		1.0911	
4月末日	19,938		1.1138	
5月末日	24,252		1.1251	
6月末日	31,638		1.1493	

グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジあり)隔月分配型

2021年6月末日及び同日前1年以内における各月末(設定来)並びに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1特定期間	(2021年 5月18日)	708	709	1.0456	1.0471
	2020年11月末日	149		1.0000	
	12月末日	248		1.0175	
	2021年 1月末日	416		1.0248	
	2月末日	558		1.0313	
	3月末日	631		1.0262	
	4月末日	692		1.0601	
	5月末日	744		1.0615	
	6月末日	789		1.0795	

グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジなし)隔月分配型

2021年6月末日及び同日前1年以内における各月末(設定来)並びに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1特定期間	(2021年 5月18日)	1,610	1,613	1.1033	1.1053
	2020年11月末日	187		1.0000	
	12月末日	430		1.0169	
	2021年 1月末日	644		1.0339	
	2月末日	922		1.0592	
	3月末日	1,342		1.0920	
	4月末日	1,502		1.1150	
	5月末日	1,798		1.1252	
	6月末日	2,352		1.1494	

分配の推移

グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	0.0010円

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	0.0010円

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1特定期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	0.0030円

各特定期間中の分配金単価の合計を表示しております。

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1特定期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	0.0040円

各特定期間中の分配金単価の合計を表示しております。

収益率の推移

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	4.8%

各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	10.4%

各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型

	計算期間	収益率
第1特定期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	4.9%

各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（期間中の分配金を加算した額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型

	計算期間	収益率
第1特定期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	10.7%

各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（期間中の分配金を加算した額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

（４）設定及び解約の実績

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	6,347,790,418	197,137,682	6,150,652,736

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	20,545,225,134	877,117,524	19,668,107,610

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1特定期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	704,781,435	27,668,750	677,112,685

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
--	------	------	------	--------

第1特定期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	1,542,043,421	82,217,674	1,459,825,747
--------	-------------------------	---------------	------------	---------------

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報

< 更新後 >

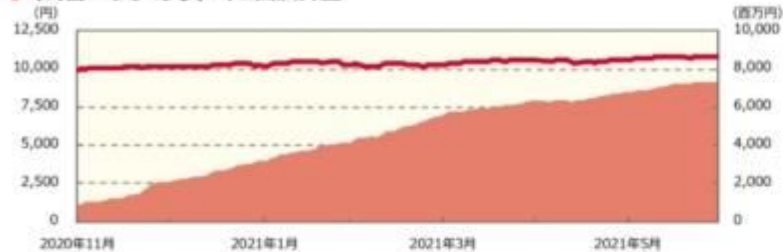


運用実績 (2021年6月30日現在)

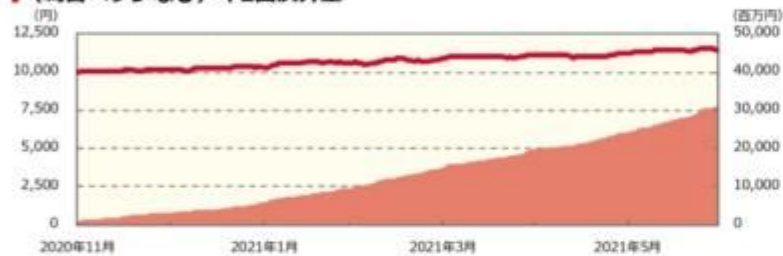
■ 基準価額・純資産の推移 (日次：設定来)

— 基準価額 (分配後、1万口あたり) (左軸) — 純資産総額 (右軸)

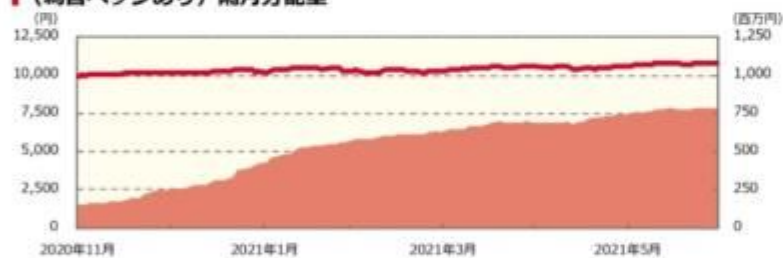
■ (為替ヘッジあり) 年2回決算型



■ (為替ヘッジなし) 年2回決算型



■ (為替ヘッジあり) 隔月分配型



■ (為替ヘッジなし) 隔月分配型



■ 分配の推移

(1万口あたり、課税前)

■ (為替ヘッジあり) 年2回決算型

2021年5月	10 円
--	--
--	--
--	--
--	--
設定来累計	10 円

■ (為替ヘッジなし) 年2回決算型

2021年5月	10 円
--	--
--	--
--	--
--	--
設定来累計	10 円

■ (為替ヘッジあり) 隔月分配型

2021年5月	15 円
2021年3月	15 円
--	--
--	--
--	--
直近1年間累計	30 円
設定来累計	30 円

■ (為替ヘッジなし) 隔月分配型

2021年5月	20 円
2021年3月	20 円
--	--
--	--
--	--
直近1年間累計	40 円
設定来累計	40 円

■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

	投資比率 (%)			
	(為替ヘッジあり)	(為替ヘッジなし)	(為替ヘッジあり)	(為替ヘッジなし)
	年2回決算型	年2回決算型	隔月分配型	隔月分配型
ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド	24.7	24.7	24.7	24.7
米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド	34.7	34.7	34.7	34.7
米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド	14.9	14.9	14.9	14.9
ACI ESGグローバルREIT マザーファンド	24.7	24.7	24.7	24.7

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)			
			(為替ヘッジあり)	(為替ヘッジなし)	(為替ヘッジあり)	(為替ヘッジなし)
			年2回決算型	年2回決算型	隔月分配型	隔月分配型
1	WINTRUST FINANCIAL CORP	銀行	0.4	0.4	0.4	0.4
2	RADNET INC	ヘルスケア・プロバイダー/ ヘルスケア・サービス	0.3	0.3	0.3	0.3
3	NOVA MEASURING INSTRUMENTS	半導体・半導体製造装置	0.3	0.3	0.3	0.3
4	PANDORA A/S	繊維・アパレル・贅沢品	0.3	0.3	0.3	0.3
5	CAPSTONE MINING CORP	金属・鉱業	0.3	0.3	0.3	0.3

・「米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)			
			(為替ヘッジあり)	(為替ヘッジなし)	(為替ヘッジあり)	(為替ヘッジなし)
			年2回決算型	年2回決算型	隔月分配型	隔月分配型
1	CNH INDUSTRIAL CAPITAL L	社債券	1.1	1.1	1.1	1.1
2	HEALTHPEAK PROPERTIES	社債券	1.0	1.0	1.0	1.0
3	HP INC	社債券	1.0	1.0	1.0	1.0
4	RALPH LAUREN CORP	社債券	1.0	1.0	1.0	1.0
5	NXP BV/NXP FDG/NXP USA	社債券	1.0	1.0	1.0	1.0

・「米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)			
			(為替ヘッジあり)	(為替ヘッジなし)	(為替ヘッジあり)	(為替ヘッジなし)
			年2回決算型	年2回決算型	隔月分配型	隔月分配型
1	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO	社債券	0.6	0.6	0.6	0.6
2	KINGDOM OF BAHRAIN	国債証券	0.6	0.6	0.6	0.6
3	ABU DHABI GOVT INT'L	国債証券	0.6	0.6	0.6	0.6
4	PANAMA GLOBAL	国債証券	0.5	0.5	0.5	0.5
5	STATE OF QATAR	国債証券	0.5	0.5	0.5	0.5

・「ACI ESGグローバルREIT マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)			
			(為替ヘッジあり)	(為替ヘッジなし)	(為替ヘッジあり)	(為替ヘッジなし)
			年2回決算型	年2回決算型	隔月分配型	隔月分配型
1	PROLOGIS INC	投資証券	2.0	2.0	2.0	2.0
2	EQUINIX INC	投資証券	1.2	1.2	1.2	1.2
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	1.1	1.1	1.1	1.1
4	INVITATION HOMES INC	投資証券	1.0	1.0	1.0	1.0
5	UDR INC	投資証券	0.9	0.9	0.9	0.9

年間収益率の推移 (暦年ベース)

■ (為替ヘッジあり) 年2回決算型



■ (為替ヘッジなし) 年2回決算型



■ (為替ヘッジあり) 隔月分配型



■ (為替ヘッジなし) 隔月分配型



・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
・2020年は設定日（2020年11月30日）から年末までの収益率。

・ファンドにベンチマークはありません。
・2021年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。●グラフの縦軸の目盛りはファンドごとに異なる場合があります。

第2【管理及び運営】

1 申込（販売）手続等

<訂正前>

- ・ 申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。
- ・ 取得申込みの受付については、午後3時までに取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。
- ・ 販売会社の営業日であっても、下記の条件に該当する日（「申込不可日」といいます。）には、原則として取得の申込みができません。

申込日当日が、以下のいずれかの休業日と同日の場合

- ・ ニューヨークの銀行
- ・ ロンドンの銀行
- ・ ニューヨーク証券取引所

申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。

ファンドの申込（販売）手続についてご不明な点がある場合には、下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

- ・ 販売の単位は、1口単位または1円単位（当初元本1口＝1円）（分配金を再投資する場合は1口単位）とします。
- ・ スイッチングのお取扱いはありません。
- ・ 販売会社によっては、一部のファンドのみのお取扱いとなる場合があります。

積立方式

販売会社によっては、「定時定額購入サービス」等に関する契約を締結した場合、当該契約で規定する取得申込の単位でお申込みいただけます。

当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあります。

- ・ 受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・ 販売会社の定める期日までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

- ・ 金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、受益権の取得申込の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込の受け付けを取り消すことができます。

購入のお申込みの方法ならびに単位等について、販売会社によっては上記と異なる場合があります。詳しく

くは販売会社にお問い合わせください。

<訂正後>

- ・ 申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。
- ・ 取得申込みの受付については、午後3時までに取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。
- ・ 販売会社の営業日であっても、下記の条件に該当する日（「申込不可日」といいます。）には、原則として取得およびスイッチングの申込みができません。

申込日当日が、以下のいずれかの休業日と同日の場合

- ・ ニューヨークの銀行
- ・ ロンドンの銀行
- ・ ニューヨーク証券取引所

申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。

ファンドの申込（販売）手続についてご不明な点がある場合には、下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

- ・ 販売の単位は、1口単位または1円単位（当初元本1口＝1円）（分配金を再投資する場合は1口単位）とします。
- ・ 販売会社によっては、一部のファンドのみのお取扱いとなる場合があります。

積立方式

販売会社によっては、「定時定額購入サービス」等に関する契約を締結した場合、当該契約で規定する取得申込の単位でお申込みいただけます。

当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあります。

- ・ 受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・ 販売会社の定める期日までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。
- ・ 「グローバルESGバランスファンド」を構成するファンド間でスイッチングができます。

スイッチングの方法等は、購入、換金の場合と同様です。

販売会社によっては、一部または全部のスイッチングのお取扱いを行わない場合があります。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

- ・ 金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉

鎖もしくは流動性の極端な減少等)があるときは、受益権の取得申込の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込の受け付けを取り消すことができます。

購入およびスイッチングのお申込みの方法ならびに単位等について、販売会社によっては上記と異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

3 資産管理等の概要

(4) 計算期間

< 訂正前 >

< 年2回決算型 >

原則として、毎年5月19日から11月18日までおよび11月19日から翌年5月18日までとします。

ただし、第1計算期間は、2020年11月30日から2021年5月18日までとします。

< 隔月分配型 >

原則として、毎年1月19日から3月18日まで、3月19日から5月18日まで、5月19日から7月18日まで、7月19日から9月18日まで、9月19日から11月18日までおよび11月19日から翌年1月18日までとします。

ただし、第1計算期間は、2020年11月30日から2021年3月18日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

< 訂正後 >

< 年2回決算型 >

原則として、毎年5月19日から11月18日までおよび11月19日から翌年5月18日までとします。

< 隔月分配型 >

原則として、毎年1月19日から3月18日まで、3月19日から5月18日まで、5月19日から7月18日まで、7月19日から9月18日まで、9月19日から11月18日までおよび11月19日から翌年1月18日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

第3【ファンドの経理状況】

グローバルE S G バランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

グローバルE S G バランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2020年11月30日から2021年5月18日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

グローバルE S G バランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型

グローバルE S G バランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は原則として6ヶ月毎に作成しております。

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(2020年11月30日から2021年5月18日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1 財務諸表

グローバルE S G バランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	第1期 (2021年 5月18日現在)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	164,769,688
親投資信託受益証券	6,365,558,566
派生商品評価勘定	1,191,702
未収入金	47,082,642
流動資産合計	6,578,602,598
資産合計	6,578,602,598
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	75,245,165
未払金	501,286
未払収益分配金	6,150,652
未払解約金	24,577,038
未払受託者報酬	1,009,637
未払委託者報酬	30,289,097
未払利息	125
その他未払費用	60,517
流動負債合計	137,833,517
負債合計	137,833,517

第1期
(2021年 5月18日現在)

純資産の部	
元本等	
元本	6,150,652,736
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	290,116,345
（分配準備積立金）	137,258,800
元本等合計	6,440,769,081
純資産合計	6,440,769,081
負債純資産合計	6,578,602,598

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	第1期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日
営業収益	
有価証券売買等損益	395,758,566
為替差損益	217,732,643
営業収益合計	178,025,923
営業費用	
支払利息	9,287
受託者報酬	1,009,637
委託者報酬	30,289,097
その他費用	68,217
営業費用合計	31,376,238
営業利益又は営業損失（ ）	146,649,685
経常利益又は経常損失（ ）	146,649,685
当期純利益又は当期純損失（ ）	146,649,685
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	3,240,233
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	156,393,488
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	156,393,488
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,535,943
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,535,943
分配金	6,150,652
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	290,116,345

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2020年11月30日から2021年 5月18日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2021年 5月18日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	6,150,652,736口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	1.0472円 (10,472円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日							
<p>1.運用の外部委託費用</p> <p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド 支払金額 12,432,549円</p> <p>ACI ESGグローバルREIT マザーファンド 支払金額 7,989,299円</p> <p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っておりません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド 支払金額 10,791,742円</p> <p>米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド 支払金額 1,807,464円</p>							
2.分配金の計算過程							
<table border="1"> <thead> <tr> <th data-bbox="175 2011 774 2056">項目</th> <th data-bbox="774 2011 1077 2056"></th> <th data-bbox="1077 2011 1380 2056"></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="175 2056 774 2094">費用控除後の配当等収益額</td> <td data-bbox="774 2056 1077 2094">A</td> <td data-bbox="1077 2056 1380 2094">36,482,569円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	36,482,569円	
項目							
費用控除後の配当等収益額	A	36,482,569円					

費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	106,926,883円
収益調整金額	C	152,857,545円
分配準備積立金額	D	0円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	296,266,997円
当ファンドの期末残存口数	F	6,150,652,736口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	481円
10,000口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	6,150,652円

3. 追加情報

2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第1期

自 2020年11月30日

至 2021年 5月18日

1. 金融商品に対する取組方針

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。

これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。

市場リスクの管理

市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。

信用リスクの管理

信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。

流動性リスクの管理

流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

第1期

2021年 5月18日現在

<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

<p>第1期</p> <p>自 2020年11月30日</p> <p>至 2021年 5月18日</p>
<p>市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていない ため、該当事項はございません。</p>

（その他の注記）

1 元本の移動

<p>第1期</p> <p>自 2020年11月30日</p> <p>至 2021年 5月18日</p>	
<p>期首元本額</p> <p>期中追加設定元本額</p> <p>期中一部解約元本額</p>	<p>- 円</p> <p>6,347,790,418円</p> <p>197,137,682円</p>

2 有価証券関係

売買目的有価証券

<p>種類</p>	<p>第1期</p> <p>自 2020年11月30日</p> <p>至 2021年 5月18日</p>
	<p>損益に含まれた評価差額（円）</p>
親投資信託受益証券	392,432,353
合計	392,432,353

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第1期(2021年 5月18日現在)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	5,861,649,666	-	5,935,703,129	74,053,463
米ドル	5,134,700,792	-	5,188,395,177	53,694,385
カナダドル	109,295,786	-	114,618,394	5,322,608
ユーロ	166,258,484	-	170,387,918	4,129,434
英ポンド	180,781,302	-	186,674,720	5,893,418
スイスフラン	3,540,464	-	3,628,770	88,306
スウェーデンクローナ	35,556,441	-	36,591,680	1,035,239
ノルウェークローネ	11,558,322	-	11,975,346	417,024
デンマーククローネ	19,339,647	-	19,715,298	375,651
豪ドル	112,538,639	-	114,731,016	2,192,377
香港ドル	59,166,610	-	59,628,460	461,850
シンガポールドル	28,913,179	-	29,356,350	443,171
合計	5,861,649,666	-	5,935,703,129	74,053,463

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年5月18日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年5月18日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	A C I E S G グローバル小型株マザーファンド	1,291,820,955	1,590,877,506	
		A C I E S G グローバル R E I T マザーファンド	1,323,823,122	1,592,162,068	
		米ドル建て E S G 先進国社債 マザーファンド	2,183,684,954	2,226,921,916	
		米ドル建て E S G 新興国国債 マザーファンド	929,750,026	955,597,076	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：98.8%	5,729,079,057	6,365,558,566 100.0%	
合計			6,365,558,566		

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

グローバル E S G バランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

(1) 貸借対照表

(単位:円)

第1期 (2021年 5月18日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	409,991,158
親投資信託受益証券	21,462,568,079
流動資産合計	21,872,559,237
資産合計	21,872,559,237
負債の部	
流動負債	
未払収益分配金	19,668,107
未払解約金	75,571,067
未払受託者報酬	2,533,573
未払委託者報酬	76,007,177
未払利息	313
その他未払費用	151,955
流動負債合計	173,932,192
負債合計	173,932,192
純資産の部	
元本等	
元本	19,668,107,610
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	2,030,519,435
(分配準備積立金)	779,823,948
元本等合計	21,698,627,045
純資産合計	21,698,627,045

第1期
(2021年 5月18日現在)

負債純資産合計 21,872,559,237

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	第1期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日
営業収益	
有価証券売買等損益	911,868,079
営業収益合計	911,868,079
営業費用	
支払利息	14,810
受託者報酬	2,533,573
委託者報酬	76,007,177
その他費用	151,955
営業費用合計	78,707,515
営業利益又は営業損失()	833,160,564
経常利益又は経常損失()	833,160,564
当期純利益又は当期純損失()	833,160,564
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	33,668,509
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,289,609,639
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,289,609,639
剰余金減少額又は欠損金増加額	38,914,152
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	38,914,152
分配金	19,668,107
期末剰余金又は期末欠損金()	2,030,519,435

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2020年11月30日から2021年 5月18日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2021年 5月18日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	19,668,107,610口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1032円
(10,000口当たり純資産額)	(11,032円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日		
1. 運用の外部委託費用		
<p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのペーパーファンドの合計額となっております。</p> <p>ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド 支払金額 12,432,549円</p> <p>ACI ESGグローバルREIT マザーファンド 支払金額 7,989,299円</p> <p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っておりません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのペーパーファンドの合計額となっております。</p> <p>米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド 支払金額 10,791,742円</p> <p>米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド 支払金額 1,807,464円</p>		
2. 分配金の計算過程		
項目	項目	金額
費用控除後の配当等収益額	A	108,742,740円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	690,749,315円
収益調整金額	C	1,250,695,487円
分配準備積立金額	D	0円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,050,187,542円
当ファンドの期末残存口数	F	19,668,107,610口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,042円
10,000口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	19,668,107円
3. 追加情報		
<p>2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。</p>		

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第1期 2021年 5月18日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日
<p>市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。</p>

（その他の注記）

1 元本の移動

第1期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日	
期首元本額	- 円
期中追加設定元本額	20,545,225,134円
期中一部解約元本額	877,117,524円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日	
	損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	908,197,202	
合計	908,197,202	

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年5月18日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年5月18日現在)

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	A C I E S Gグローバル小型株マザーファンド	4,356,045,572	5,364,470,121	
		A C I E S GグローバルREITマザーファンド	4,463,521,100	5,368,276,826	
		米ドル建てESG先進国社債マザーファンド	7,362,104,675	7,507,874,347	
		米ドル建てESG新興国国債マザーファンド	3,134,799,363	3,221,946,785	
	小計	銘柄数：4	19,316,470,710	21,462,568,079	

	組入時価比率：98.9%		100.0%
合計			21,462,568,079

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジあり)隔月分配型

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	当期 (2021年 5月18日現在)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	17,341,626
親投資信託受益証券	699,724,462
派生商品評価勘定	52,907
未収入金	2,583,711
流動資産合計	719,702,706
資産合計	719,702,706
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,713,466
未払金	69,458
未払収益分配金	1,015,669
未払受託者報酬	61,269
未払委託者報酬	1,838,036
未払利息	13
その他未払費用	3,655
流動負債合計	11,701,566
負債合計	11,701,566
純資産の部	
元本等	
元本	677,112,685
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	30,888,455
(分配準備積立金)	14,379,032
元本等合計	708,001,140
純資産合計	708,001,140
負債純資産合計	719,702,706

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	当期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日
営業収益	
有価証券売買等損益	49,594,462
為替差損益	28,760,186
営業収益合計	20,834,276
営業費用	
支払利息	1,023

	当期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日
受託者報酬	122,510
委託者報酬	3,675,266
その他費用	14,991
営業費用合計	3,813,790
営業利益又は営業損失（ ）	17,020,486
経常利益又は経常損失（ ）	17,020,486
当期純利益又は当期純損失（ ）	17,020,486
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	388,681
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	17,138,754
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	17,138,754
剰余金減少額又は欠損金増加額	982,095
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	982,095
分配金	1,900,009
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	30,888,455

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当該財務諸表の特定期間は、2020年11月30日から2021年 5月18日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

当期 2021年 5月18日現在	
1. 特定期間の末日における受益権の総数	677,112,685口

2. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額

1口当たり純資産額	1.0456円
(10,000口当たり純資産額)	(10,456円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

当期

自 2020年11月30日

至 2021年 5月18日

1. 運用の外部委託費用

当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用

なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。

ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド

支払金額 12,432,549円

ACI ESGグローバルREIT マザーファンド

支払金額 7,989,299円

当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っておりません。

また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。

米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド

支払金額 10,791,742円

米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

支払金額 1,807,464円

2. 分配金の計算過程

2020年11月30日から2021年 3月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,073,980円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	8,326,635円
収益調整金額	C	12,218,396円
分配準備積立金額	D	0円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	22,619,011円
当ファンドの期末残存口数	F	589,560,601口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	383円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	884,340円

2021年 3月19日から2021年 5月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,160,665円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	4,070,525円
収益調整金額	C	16,509,423円
分配準備積立金額	D	9,163,511円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	31,904,124円

当ファンドの期末残存口数	F	677,112,685口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	471円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	1,015,669円

3. 追加情報

2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

当期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

当期 2021年 5月18日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> <p>2. 時価の算定方法</p>

親投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（関連当事者との取引に関する注記）

当期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

1 元本の移動

当期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日	
期首元本額	- 円
期中追加設定元本額	704,781,435円
期中一部解約元本額	27,668,750円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	当期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日
	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	11,011,049
合計	11,011,049

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	当期(2021年 5月18日現在)		
	契約額等（円）		時価（円）
	うち1年超		
			評価損益（円）

市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	645,125,199	-	653,785,758	8,660,559
米ドル	565,018,730	-	571,372,647	6,353,917
カナダドル	12,870,345	-	13,489,294	618,949
ユーロ	18,276,752	-	18,726,000	449,248
英ポンド	19,739,112	-	20,398,061	658,949
スイスフラン	237,440	-	241,917	4,477
スウェーデンクローナ	3,876,105	-	3,988,480	112,375
ノルウェークローネ	1,276,576	-	1,323,432	46,856
デンマーククローネ	2,082,718	-	2,125,097	42,379
豪ドル	12,217,035	-	12,483,441	266,406
香港ドル	6,227,363	-	6,284,820	57,457
シンガポールドル	3,303,023	-	3,352,569	49,546
合計	645,125,199	-	653,785,758	8,660,559

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価していません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年5月18日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年5月18日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

親投資信託受益証券	日本円	ACI ESGグローバル小型株マザーファンド	141,949,033	174,810,234	
		ACI ESGグローバルREITマザーファンド	145,532,821	175,032,323	
		米ドル建てESG先進国社債マザーファンド	240,068,509	244,821,865	
		米ドル建てESG新興国国債マザーファンド	102,218,370	105,060,040	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：98.8%	629,768,733	699,724,462	100.0%
合計				699,724,462	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジなし)隔月分配型

(1) 貸借対照表

(単位：円)

当期
(2021年5月18日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	24,603,242
親投資信託受益証券	1,594,511,106
流動資産合計	1,619,114,348
資産合計	1,619,114,348
負債の部	
流動負債	
未払収益分配金	2,919,651
未払解約金	1,498,071
未払受託者報酬	128,730
未払委託者報酬	3,861,810
未払利息	18
その他未払費用	7,705
流動負債合計	8,415,985
負債合計	8,415,985
純資産の部	
元本等	
元本	1,459,825,747
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	150,872,616
(分配準備積立金)	73,897,324
元本等合計	1,610,698,363
純資産合計	1,610,698,363
負債純資産合計	1,619,114,348

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	当期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日
営業収益	
有価証券売買等損益	90,631,106
営業収益合計	90,631,106
営業費用	
支払利息	1,082
受託者報酬	231,948
委託者報酬	6,958,355
その他費用	13,863
営業費用合計	7,205,248
営業利益又は営業損失（ ）	83,425,858
経常利益又は経常損失（ ）	83,425,858
当期純利益又は当期純損失（ ）	83,425,858
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	902,834
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	80,268,084
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	80,268,084
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,885,978
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,885,978
分配金	5,032,514
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	150,872,616

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当該財務諸表の特定期間は、2020年11月30日から2021年 5月18日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

	当期 2021年 5月18日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数	1,459,825,747口
2. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額	1.1033円

(10,000口当たり純資産額)

(11,033円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

当期

自 2020年11月30日

至 2021年 5月18日

1. 運用の外部委託費用

当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用

なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。

ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド

支払金額 12,432,549円

ACI ESGグローバルREIT マザーファンド

支払金額 7,989,299円

当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っておりません。

また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。

米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド

支払金額 10,791,742円

米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

支払金額 1,807,464円

2. 分配金の計算過程

2020年11月30日から2021年 3月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,959,298円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	57,990,905円
収益調整金額	C	34,206,799円
分配準備積立金額	D	0円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	96,157,002円
当ファンドの期末残存口数	F	1,056,431,639口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	910円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,112,863円

2021年 3月19日から2021年 5月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,138,207円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	15,434,614円
収益調整金額	C	76,975,292円
分配準備積立金額	D	56,244,154円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	153,792,267円
当ファンドの期末残存口数	F	1,459,825,747口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,053円

10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	2,919,651円

3. 追加情報

2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

当期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

当期 2021年 5月18日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

当期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

1 元本の移動

当期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日	
期首元本額	- 円
期中追加設定元本額	1,542,043,421円
期中一部解約元本額	82,217,674円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	当期 自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日
	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	24,959,980
合計	24,959,980

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年5月18日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年5月18日現在)

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

親投資信託受益証券	日本円	ACI ESGグローバル小型株マザーファンド	323,460,957	398,342,168	
		ACI ESGグローバルREITマザーファンド	331,629,417	398,850,699	
		米ドル建てESG先進国社債マザーファンド	547,065,025	557,896,912	
		米ドル建てESG新興国国債マザーファンド	232,945,444	239,421,327	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.0%	1,435,100,843	1,594,511,106	100.0%
合計				1,594,511,106	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「グローバルESGバランスファンド」の各ファンドは「ACI ESGグローバル小型株マザーファンド」、「米ドル建てESG先進国社債マザーファンド」、「米ドル建てESG新興国国債マザーファンド」および「ACI ESGグローバルREITマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

ACI ESGグローバル小型株マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2021年 5月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	444,001,632
コール・ローン	76,769,644
株式	7,124,052,575
投資信託受益証券	37,222,103
投資証券	182,324,411
派生商品評価勘定	403,667
未収入金	449,075,549
未収配当金	4,059,597
流動資産合計	8,317,909,178
資産合計	
8,317,909,178	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	309,948
未払金	789,365,399
未払利息	58
流動負債合計	789,675,405
負債合計	
789,675,405	
純資産の部	
元本等	
元本	6,113,276,517
剰余金	

(2021年 5月18日現在)

期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,414,957,256
元本等合計	7,528,233,773
純資産合計	7,528,233,773
負債純資産合計	8,317,909,178

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2021年 5月18日現在

1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.2315円
(10,000口当たり純資産額)	(12,315円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2021年 5月18日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 5月18日現在	
期首	2020年11月30日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	- 円
同期中における追加設定元本額	6,177,198,054円
同期中における一部解約元本額	63,921,537円
期末元本額	6,113,276,517円
期末元本額の内訳*	
グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型	1,291,820,955円
グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型	4,356,045,572円
グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型	141,949,033円
グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型	323,460,957円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年5月18日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	クラレ	28,600	1,149.00	32,861,400	
		日本ゼオン	36,200	1,684.00	60,960,800	
		日本製鋼所	10,600	2,674.00	28,344,400	
		CKD	13,100	2,294.00	30,051,400	
		アンリツ	5,400	2,041.00	11,021,400	
		アシックス	16,800	2,357.00	39,597,600	
		Appier Group	27,400	1,391.00	38,113,400	
		ネクステージ	35,100	1,662.00	58,336,200	
		FOOD & LIFE COMPANIE	9,700	4,745.00	46,026,500	
		日本瓦斯	30,100	1,975.00	59,447,500	
		オープンハウス	10,600	4,660.00	49,396,000	
		エン・ジャパン	10,300	3,545.00	36,513,500	
	小計	銘柄数：12 組入時価比率：6.5%			490,670,100	6.9%
	米ドル	DIVERSEY HOLDINGS LTD	27,432	16.30	447,141.60	

H B FULLER CO	11,601	69.09	801,513.09
HUNTSMAN CORP	22,117	29.71	657,096.07
SUMMIT MATERIALS INC -CL A	22,360	34.13	763,146.80
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	15,555	42.40	659,532.00
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	12,639	47.95	606,040.05
MASONITE INTERNATIONAL CORP	5,748	124.07	713,154.36
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,886	58.03	457,624.58
EVOQUA WATER TECHNOLOGIES CO	12,284	29.03	356,604.52
KORNIT DIGITAL LTD	6,206	89.30	554,195.80
CLEAN HARBORS INC	7,876	93.83	739,005.08
SP PLUS CORP	19,883	33.50	666,080.50
JETBLUE AIRWAYS CORPORATION	27,879	19.91	555,070.89
ARCBEST CORP	7,254	82.59	599,107.86
FOX FACTORY HOLDING CORP	4,810	158.27	761,278.70
LOVESAC CO/THE	7,006	76.72	537,500.32
SKYLINE CHAMPION CORP	3,873	41.42	160,419.66
BRUNSWICK CORP	6,599	106.04	699,757.96
CALLAWAY GOLF COMPANY	23,062	34.49	795,408.38
CAPRI HOLDINGS LTD	16,134	57.88	933,835.92
CROCS INC	7,020	103.88	729,237.60
DECKERS OUTDOOR CORP	1,551	341.24	529,263.24
BLOOMIN BRANDS INC	17,853	28.97	517,201.41
PLANET FITNESS INC - CL A	6,463	78.94	510,189.22
TRAVEL + LEISURE CO	12,303	65.48	805,600.44
WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC	9,143	75.13	686,913.59
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	24,380	37.22	907,423.60
ARKO CORP	29,920	10.53	315,057.60
LESLIE'S INC	6,288	26.87	168,958.56
RH	1,005	633.31	636,476.55
MGP INGREDIENTS INC	5,035	67.60	340,366.00
ELF BEAUTY INC	24,232	29.27	709,270.64
AXOGEN INC	22,990	21.08	484,629.20
ORTHO CLINICAL DIAGNOSTICS H	30,508	20.47	624,498.76
SEASPINE HOLDINGS CORP	17,644	20.01	353,056.44
SI-BONE INC	10,701	31.54	337,509.54

SILK ROAD MEDICAL INC	4,268	46.54	198,632.72
TANDEM DIABETES CARE INC	2,377	78.53	186,665.81
ENCOMPASS HEALTH CORP	3,633	86.81	315,380.73
INNOVAGE HOLDING CORP	14,052	20.82	292,562.64
OPTION CARE HEALTH INC	25,509	17.25	440,030.25
R1 RCM INC	34,429	24.09	829,394.61
RADNET INC	29,960	23.39	700,764.40
NATERA INC	4,864	91.81	446,563.84
GLACIER BANCORP INC	14,206	61.51	873,811.06
SILVERGATE CAPITAL CORP-CL A	4,092	91.24	373,354.08
TCF FINANCIAL CORP	11,623	47.50	552,092.50
TRIUMPH BANCORP INC	6,924	85.10	589,232.40
WINTRUST FINANCIAL CORP	14,510	80.84	1,172,988.40
CANNAE HOLDINGS INC	4,570	36.83	168,313.10
BRP GROUP INC-A	15,679	25.00	391,975.00
GOOSEHEAD INSURANCE INC -A	717	82.41	59,087.97
KINSALE CAPITAL GROUP INC	2,003	159.19	318,857.57
21VIANET GROUP INC-ADR	13,698	24.80	339,710.40
DIGITALOCEAN HOLDINGS INC	5,121	36.27	185,738.67
I3 VERTICALS INC-CLASS A	13,932	30.36	422,975.52
MAXIMUS INC	4,400	90.62	398,728.00
REPAY HOLDINGS CORP	15,953	22.58	360,218.74
MANHATTAN ASSOCIATES, INC.	3,497	132.18	462,233.46
NCINO INC	1,984	50.48	100,152.32
SAILPOINT TECHNOLOGIES HOLDI	6,478	44.28	286,845.84
SPROUT SOCIAL INC - CLASS A	7,027	62.76	441,014.52
JABIL INC	13,611	54.00	734,994.00
NATIONAL INSTRUMENTS CORP	4,554	39.16	178,334.64
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	7,397	47.27	349,656.19
MACOM TECHNOLOGY SOLUTIONS HOLDINGS INC	5,785	50.72	293,415.20
NOVA MEASURING INSTRUMENTS	9,579	87.43	837,491.97
ONTO INNOVATION INC	5,424	58.30	316,219.20
POWER INTEGRATIONS INC	4,116	76.14	313,392.24
SEMTECH CORP	5,387	61.04	328,822.48
VEECO INSTRUMENTS INC	16,378	22.28	364,901.84

	OPEN LENDING CORP - CL A	19,474	35.08	683,147.92	
	HEALTH CATALYST INC	3,405	47.17	160,613.85	
	NEOGENOMICS INC	7,986	37.63	300,513.18	
	KORN FERRY	10,415	67.49	702,908.35	
	NEWMARK GROUP INC-CLASS A	46,714	13.21	617,091.94	
	ENDEAVOR GROUP HOLD-CLASS A	12,126	31.64	383,666.64	
	QUINSTREET INC	31,157	17.85	556,152.45	
小計	銘柄数：78			39,147,813.17	
				(4,275,724,154)	
	組入時価比率：56.8%			59.9%	
カナダドル	WHITECAP RESOURCES INC	107,458	5.94	638,300.52	
	CAPSTONE MINING CORP	249,661	6.07	1,515,442.27	
	TFI INTERNATIONAL INC	6,275	109.77	688,806.75	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	4,769	98.23	468,458.87	
	ECN CAPITAL CORP	117,094	8.25	966,025.50	
	BORALEX INC -A	8,971	34.81	312,280.51	
	COLLIERS INTERNATIONAL GROUP	6,178	129.69	801,224.82	
小計	銘柄数：7			5,390,539.24	
				(488,167,233)	
	組入時価比率：6.5%			6.9%	
リアル	PET CENTER COMERCIO E PARTIC	85,100	22.50	1,914,750.00	
	LOCAWEB SERVICOS DE INTERNET	82,000	22.77	1,867,140.00	
小計	銘柄数：2			3,781,890.00	
				(78,288,904)	
	組入時価比率：1.0%			1.1%	
ユーロ	CORBION NV	7,488	48.38	362,269.44	
	APERAM	13,433	46.58	625,709.14	
	METSO OUTOTEC OYJ	78,285	9.40	735,879.00	
	BASIC-FIT NV	10,669	35.48	378,536.12	
	D IETEREN SA/NV	5,046	89.25	450,355.50	
	HYPOPORT SE	627	445.20	279,140.40	
	MELEXIS NV	4,186	81.10	339,484.60	
	S.O.I.T.E.C.	2,448	148.10	362,548.80	
	FLATEX AG	4,370	95.40	416,898.00	
小計	銘柄数：9			3,950,821.00	

				(524,550,504)	
		組入時価比率：7.0%		7.3%	
英ボンド	WEIR GROUP PLC	27,873	18.36	511,887.64	
	ELECTROCOMPONENTS PLC	57,591	10.07	579,941.37	
	HOWDEN JOINERY GROUP PLC	63,027	7.90	498,417.51	
	HOMESERVE PLC	9,500	10.37	98,515.00	
	DR.MARTENS PLC-WI	80,001	4.57	365,604.57	
	BOOHOO GROUP PLC	37,621	3.20	120,387.20	
	PETS AT HOME GROUP PLC	58,955	4.30	253,978.14	
	FEVERTREE DRINKS PLC	10,093	25.40	256,362.20	
	IWG PLC	80,959	3.59	291,047.60	
	S4 CAPITAL PLC	64,031	5.12	327,838.72	
小計	銘柄数：10			3,303,979.95	(510,696,180)
		組入時価比率：6.8%		7.2%	
スイスフラン	SIG COMBIBLOC GROUP AG	7,337	22.58	165,669.46	
	小計	銘柄数：1		165,669.46	(20,029,437)
		組入時価比率：0.3%		0.3%	
スウェーデン ローナ	LIFCO AB-B SHS	26,097	167.05	4,359,503.85	
	TRELLEBORG AB-B SHS	26,169	221.60	5,799,050.40	
	SINCH AB	1,016	1,282.50	1,303,020.00	
	NORDIC ENTERTAINMENT GROUP-B	6,826	344.60	2,352,239.60	
	STILLFRONT GROUP AB	18,408	73.35	1,350,226.80	
	小計	銘柄数：5			15,164,040.65
		組入時価比率：2.6%		2.8%	
ノルウェー ローネ	BAKKAFROST P/F	6,695	685.20	4,587,414.00	
	小計	銘柄数：1		4,587,414.00	(60,737,361)
		組入時価比率：0.8%		0.9%	
デンマーク ローネ	PANDORA A/S	7,951	757.60	6,023,677.60	
	小計	銘柄数：1		6,023,677.60	(107,522,645)

		組入時価比率：1.4%			1.5%
豪ドル	CHAMPION IRON LTD		96,988	7.18	696,373.84
	NICKEL MINES LTD		358,957	1.01	362,546.57
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD		25,390	19.92	505,768.80
小計	銘柄数：3				1,564,689.21 (132,889,054)
		組入時価比率：1.8%			1.9%
香港ドル	CHINA YONGDA AUTOMOBILES SERVICES HOLDIN		404,500	13.42	5,428,390.00
	小計	銘柄数：1			5,428,390.00 (76,323,163)
		組入時価比率：1.0%			1.1%
ウォン	SK MATERIALS CO LTD		1,717	315,900.00	542,400,300.00
	小計	銘柄数：1			542,400,300.00 (52,178,908)
		組入時価比率：0.7%			0.7%
新台幣ドル	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP		17,000	970.00	16,490,000.00
	ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION		27,000	273.00	7,371,000.00
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD		9,000	416.00	3,744,000.00
	小計	銘柄数：3			27,605,000.00 (107,322,719)
		組入時価比率：1.4%			1.5%
合計					7,124,052,575 (6,633,382,475)

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2)株式以外の有価証券(2021年5月18日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	SCHWAB INTL SMALL-CAP EQUITY	4,093	169,859.50	
		SCHWAB US SMALL-CAP ETF	1,696	170,939.84	
	小計	銘柄数：2	5,789	340,799.34 (37,222,103)	
		組入時価比率：0.5%			17.0%

	合計			37,222,103	
				(37,222,103)	
投資証券	米ドル	GLOBAL MEDICAL REIT INC	51,467	735,978.10	
		HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE	3,470	162,638.90	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	10,341	770,714.73	
	小計	銘柄数：3	65,278	1,669,331.73	
		組入時価比率：2.4%		(182,324,411)	83.0%
	合計			182,324,411	
				(182,324,411)	
	合計			219,546,514	
				(219,546,514)	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注4)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2021年 5月18日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	191,261,192	-	190,952,616	308,576
カナダドル	65,105,144	-	65,013,298	91,846
ユーロ	44,382,222	-	44,293,657	88,565
英ポンド	55,252,691	-	55,183,573	69,118
スイスフラン	2,533,336	-	2,524,013	9,323
スウェーデンクローナ	14,179,153	-	14,154,464	24,689
デンマーククローネ	9,808,646	-	9,783,611	25,035
売建	228,721,937	-	228,319,642	402,295
米ドル	228,721,937	-	228,319,642	402,295
合計	-	-	-	93,719

(注)時価の算定方法

1 為替予約取引

1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

米ドル建て E S G 先進国社債 マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
(2021年 5月18日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	172,933,388
コール・ローン	319,805,236
社債券	10,105,286,881
派生商品評価勘定	140
未収利息	56,510,361
前払費用	33,981,790
流動資産合計	10,688,517,796
資産合計	10,688,517,796
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	47,000
未払金	119,052,913
未払解約金	31,640,000
未払利息	244
流動負債合計	150,740,157
負債合計	150,740,157
純資産の部	
元本等	
元本	10,332,923,163
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	204,854,476
元本等合計	10,537,777,639
純資産合計	10,537,777,639
負債純資産合計	10,688,517,796

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	社債券
--------------------	-----

	<p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2021年 5月18日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0198円
(10,000口当たり純資産額)	(10,198円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。

市場リスクの管理

市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。

信用リスクの管理

信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。

流動性リスクの管理

流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2021年 5月18日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
社債券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 5月18日現在	
期首	2020年11月30日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	- 円
同期中における追加設定元本額	10,412,540,688円
同期中における一部解約元本額	79,617,525円
期末元本額	10,332,923,163円
期末元本額の内訳*	
グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	2,183,684,954円
グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジなし)年2回決算型	7,362,104,675円
グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジあり)隔月分配型	240,068,509円
グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジなし)隔月分配型	547,065,025円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年5月18日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年5月18日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	AES CORP/THE	3,000,000.00	3,233,010.00	
		ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	1,000,000.00	1,149,419.70	
		ASHTREAD CAPITAL INC	3,100,000.00	3,266,408.00	
		AVANGRID INC	2,530,000.00	2,808,353.13	
		BEST BUY CO INC	3,200,000.00	3,678,827.19	
		CMS ENERGY CORP	2,900,000.00	3,190,000.00	
		CNH INDUSTRIAL CAPITAL L	3,700,000.00	4,110,938.28	
		DELL INT LLC / EMC CORP	2,550,000.00	3,118,977.67	
		DOMINION ENERGY INC	2,950,000.00	3,112,250.00	
		E.ON INTL FINANCE BV	2,400,000.00	3,395,331.84	
		EDP FINANCE BV	1,000,000.00	975,417.80	
		ENEL FINANCE INTL NV	2,900,000.00	3,414,276.72	
		FEDEX CORP	3,400,000.00	3,679,592.20	
		GENERAL ELECTRIC CO	1,800,000.00	1,993,389.48	
		GENERAL MILLS INC	1,200,000.00	1,250,380.44	
		HASBRO INC	350,000.00	383,250.07	
		HEALTHPEAK PROPERTIES	3,600,000.00	3,699,992.52	
		HP INC	3,500,000.00	3,716,039.58	
		JABIL INC	3,050,000.00	3,276,943.46	
		KROGER CO	1,000,000.00	940,639.50	
		MCDONALD'S CORP	1,000,000.00	1,103,400.60	
		MOLSON COORS BREWING CO	1,500,000.00	1,591,417.20	
		NEXTERA ENERGY CAPITAL	3,600,000.00	3,561,263.27	
		NXP BV/NXP FDG/NXP USA	3,400,000.00	3,641,130.72	
		RALPH LAUREN CORP	3,500,000.00	3,648,809.50	
		RAYTHEON TECH CORP	3,100,000.00	3,005,886.48	
		SSE PLC	2,500,000.00	2,594,210.00	
		STARBUCKS CORP	3,600,000.00	3,637,585.08	
		SYSCO CORPORATION	1,000,000.00	1,270,793.90	
		VENTAS REALTY LP/CAP CRP	2,600,000.00	2,945,361.64	
		VF CORP	1,300,000.00	1,357,595.32	
		WALGREENS BOOTS ALLIANCE	3,450,000.00	3,640,059.46	
		WEA FINANCE LLC/WESTFIEL	2,900,000.00	3,093,695.64	
	WELLTOWER INC	3,000,000.00	3,037,665.29		
小計		銘柄数：34	85,580,000.00	92,522,311.68 (10,105,286,881)	
		組入時価比率：95.9%		100.0%	
合計				10,105,286,881	

(10,105,286,881)

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2021年 5月18日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	207,561,700	-	207,514,840	46,860
米ドル	207,561,700	-	207,514,840	46,860
合計	207,561,700	-	207,514,840	46,860

(注)時価の算定方法

1 為替予約取引

1)計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2)計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価していません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2021年 5月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	92,174,527
コール・ローン	148,784,417
国債証券	3,333,159,450
特殊債券	321,013,162
社債券	601,219,139
派生商品評価勘定	16,566
未収利息	26,560,170
前払費用	14,136,880
流動資産合計	4,537,064,311
資産合計	4,537,064,311
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	73,440
未払解約金	15,080,000
未払利息	113
流動負債合計	15,153,553

(2021年 5月18日現在)

負債合計	15,153,553
純資産の部	
元本等	
元本	4,399,713,203
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	122,197,555
元本等合計	4,521,910,758
純資産合計	4,521,910,758
負債純資産合計	4,537,064,311

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、特殊債券、社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2021年 5月18日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0278円
(10,000口当たり純資産額)	(10,278円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2020年11月30日 至 2021年 5月18日

1. 金融商品に対する取組方針

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。

市場リスクの管理

市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。

信用リスクの管理

信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。

流動性リスクの管理

流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2021年 5月18日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法

国債証券、特殊債券、社債券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 5月18日現在

期首	2020年11月30日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	- 円
同期中における追加設定元本額	4,441,180,227円
同期中における一部解約元本額	41,467,024円
期末元本額	4,399,713,203円
期末元本額の内訳*	
グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型	929,750,026円
グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型	3,134,799,363円

グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジあり)隔月分配型	102,218,370円
グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジなし)隔月分配型	232,945,444円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年5月18日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年5月18日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	217,808.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	1,420,000.00	1,655,294.00	
		BRAZIL GLOBAL	150,000.00	207,864.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	300,000.00	314,565.39	
		CHINA GOVT INTL BOND	500,000.00	542,079.20	
		CHINA GOVT INTL BOND	1,200,000.00	1,139,335.44	
		COLOMBIA GLOBAL	1,090,000.00	1,433,905.90	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	400,000.00	411,200.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,620,000.00	1,726,952.40	
		HUNGARY	580,000.00	655,532.24	
		INDONESIA GLOBAL	680,000.00	1,073,812.27	
		INDONESIA GLOBAL	950,000.00	1,280,443.25	
		KINGDOM OF BAHRAIN	200,000.00	216,316.80	
		KINGDOM OF BAHRAIN	1,540,000.00	1,772,709.40	
		MEXICO GLOBAL	1,450,000.00	1,903,589.00	
		OMAN GOV INTERNTL BOND	1,820,000.00	1,905,540.00	
		OMAN GOV INTERNTL BOND	400,000.00	416,000.00	
		OMAN GOV INTERNTL BOND	400,000.00	457,616.40	
		PANAMA GLOBAL	1,260,000.00	1,749,598.20	
		PANAMA GLOBAL	300,000.00	402,541.50	
		PERU GLOBAL	1,230,000.00	1,670,407.65	
		REPUBLIC OF AZERBAIJAN	750,000.00	760,342.50	
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	199,150.00	
		REPUBLIC OF CHILE	840,000.00	891,189.60	
		REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	213,514.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA	800,000.00	871,064.00	
		REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	209,199.00	
		REPUBLIC OF PERU	820,000.00	840,147.40	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY	1,100,000.00	1,259,775.00	

		REPUBLICA ORIENT URUGUAY	80,000.00	120,681.20	
		ROMANIA	200,000.00	222,078.60	
		ROMANIA	850,000.00	870,102.50	
		STATE OF QATAR	1,240,000.00	1,718,652.40	
		STATE OF QATAR	200,000.00	259,197.00	
		UNITED MEXICAN STATES	400,000.00	434,858.00	
		UNITED MEXICAN STATES	440,000.00	494,786.60	
	小計	銘柄数：36	26,010,000.00	30,517,848.84	
		組入時価比率：73.7%		(3,333,159,450)	78.4%
	合計			3,333,159,450	
				(3,333,159,450)	
特殊債券	米ドル	BANCO CENTRAL COSTA RICA	1,000,000.00	1,026,260.00	
		EXPORT IMPORT BANK CHINA	200,000.00	219,100.92	
		EXPORT IMPORT BANK CHINA	200,000.00	234,106.00	
		PETROLIAM NASIONAL BERHD	1,110,000.00	1,459,675.75	
	小計	銘柄数：4	2,510,000.00	2,939,142.67	
		組入時価比率：7.1%		(321,013,162)	7.5%
	合計			321,013,162	
				(321,013,162)	
社債券	米ドル	CODELCO INC	400,000.00	432,784.92	
		CODELCO INC	760,000.00	990,891.26	
		CODELCO INC	200,000.00	258,263.86	
		KAZMUNAYGAS NATIONAL CO	1,460,000.00	1,734,240.56	
		PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR	600,000.00	692,157.00	
		PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR	600,000.00	599,184.00	
		PETROLEOS MEXICANOS	600,000.00	592,590.00	
		PETROLEOS MEXICANOS	200,000.00	204,550.00	
	小計	銘柄数：8	4,820,000.00	5,504,661.60	
		組入時価比率：13.3%		(601,219,139)	14.1%
	合計			601,219,139	
				(601,219,139)	
	合計			4,255,391,751	
				(4,255,391,751)	

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2021年 5月18日現在	
	契約額等(円)	

		うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	124,565,940	-	124,509,066	56,874
米ドル	124,565,940	-	124,509,066	56,874
合計	124,565,940	-	124,509,066	56,874

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

A C I ESG グローバル R E I T マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2021年 5月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	198,288,163
コール・ローン	114,460,630
株式	561,208,241
投資証券	6,787,284,880
派生商品評価勘定	80,551
未収入金	57,972,679
未収配当金	6,905,302
流動資産合計	7,726,200,446
資産合計	
7,726,200,446	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	46,906
未払金	191,582,375
未払解約金	300,000
未払利息	87
流動負債合計	191,929,368
負債合計	
191,929,368	
純資産の部	
元本等	
元本	6,264,506,460
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	1,269,764,618
元本等合計	7,534,271,078
純資産合計	
7,534,271,078	
負債純資産合計	
7,726,200,446	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>配当株式 配当株式は原則として、配当株式に伴う源泉税等の費用が確定した段階で、株式の配当落ち日に計上した数量に相当する券面額又は発行価額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2021年 5月18日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1,2027円
(10,000口当たり純資産額)	(12,027円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2020年11月30日

至 2021年 5月18日

1. 金融商品に対する取組方針

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

これらは、REITの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。

市場リスクの管理

市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。

信用リスクの管理

信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。

流動性リスクの管理

流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2021年 5月18日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 5月18日現在

期首

2020年11月30日

本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額

- 円

同期中における追加設定元本額	6,329,913,939円
同期中における一部解約元本額	65,407,479円
期末元本額	6,264,506,460円
期末元本額の内訳*	
グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	1,323,823,122円
グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジなし)年2回決算型	4,463,521,100円
グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジあり)隔月分配型	145,532,821円
グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジなし)隔月分配型	331,629,417円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年5月18日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考	
				単価	金額		
株式	日本円	オープンハウス	18,100	4,660.00	84,346,000		
		小計	銘柄数：1			84,346,000	
			組入時価比率：1.1%				15.0%
	米ドル	TRAVEL + LEISURE CO	13,311	65.48	871,604.28		
		小計	銘柄数：1			871,604.28	
			組入時価比率：1.3%			(95,196,619)	17.0%
	カナダドル	TRICON RESIDENTIAL INC	46,701	13.20	616,453.20		
		小計	銘柄数：1			616,453.20	
			組入時価比率：0.7%			(55,826,001)	9.9%
	ユーロ	CELLNEX TELECOM SA	14,934	45.96	686,366.64		
		CTP NV W/I	34,469	14.30	492,906.70		
		VGP NV	1,945	152.20	296,029.00		
小計		銘柄数：3			1,475,302.34		
					(195,875,891)	34.9%	
英ポンド	TAYLOR WIMPEY PLC	268,232	1.75	471,149.50			
	小計	銘柄数：1			471,149.50		
					(72,825,578)	13.0%	
						組入時価比率：1.0%	

香港ドル	GDS HOLDINGS LIMITED	56,600	71.80	4,063,880.00	
小計	銘柄数：1			4,063,880.00	
				(57,138,152)	
	組入時価比率：0.8%			10.2%	
合計				561,208,241	
				(476,862,241)	

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2)株式以外の有価証券(2021年5月18日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	805	115,839,500	
		コンフォリア・レジデンシャル投資 法人 投資証券	169	57,122,000	
		ラサールロジポート投資法人 投資 証券	448	77,548,800	
		三菱地所物流リート投資法人 投資 証券	176	78,232,000	
		オリックス不動産投資法人 投資証 券	641	125,315,500	
		インヴィンシブル投資法人 投資証 券	1,321	57,463,500	
	小計	銘柄数：6	3,560	511,521,300	
		組入時価比率：6.8%		7.5%	
	米ドル	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	13,488	629,350.08	
		AMERICOLD REALTY TRUST	19,609	743,965.46	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	45,026	1,009,032.66	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	7,402	351,150.88	
		CROWN CASTLE INTL CORP	3,967	721,994.00	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	81,099	930,205.53	
EQUINIX INC		4,380	3,131,831.40		
EQUITY RESIDENTIAL		29,485	2,181,005.45		
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	22,200	556,110.00			
ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,368	1,258,551.84			
EXTRA SPACE STORAGE INC	13,201	1,922,197.61			

	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	7,056	1,218,924.00	
	INVITATION HOMES INC	82,745	2,910,141.65	
	IRON MOUNTAIN INC	25,940	1,129,687.00	
	KILROY REALTY CORP	16,241	1,081,650.60	
	KIMCO REALTY CORP	42,728	901,988.08	
	LIFE STORAGE INC	19,390	1,873,461.80	
	NETSTREIT CORP	27,422	586,830.80	
	PENNYMAC MORTGAGE INVESTMENT TRUST	22,166	424,257.24	
	POTLATCHDELTIC CORP	5,412	323,312.88	
	PROLOGIS INC	46,166	5,271,695.54	
	QTS REALTY TRUST INC CL A	17,702	1,101,418.44	
	REALTY INCOME CORP	26,124	1,708,509.60	
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	15,611	842,213.45	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	26,725	3,266,864.00	
	SUN COMMUNITIES INC	9,739	1,596,709.05	
	UDR INC	51,264	2,378,649.60	
	URBAN EDGE PROPERTIES	45,333	861,780.33	
	VENTAS INC	20,818	1,129,792.86	
	VICI PROPERTIES INC	46,298	1,444,034.62	
	WELLTOWER INC	24,581	1,797,362.72	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	31,016	596,747.84	
小計	銘柄数：32	854,702	45,881,427.01	
			(5,011,169,458)	
	組入時価比率：66.5%		73.8%	
カナダドル	CHARTWELL RETIREMENT RESIDENCES	42,989	564,445.57	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,987	555,117.15	
小計	銘柄数：2	49,976	1,119,562.72	
			(101,387,599)	
	組入時価比率：1.3%		1.5%	
ユーロ	KLEPIERRE	33,434	757,948.78	
小計	銘柄数：1	33,434	757,948.78	
			(100,632,859)	
	組入時価比率：1.3%		1.5%	
英ポンド	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	264,368	449,689.96	

	小計	SEGR0 PLC	87,660	875,723.40	
		SHAFTESBURY PLC	76,503	476,996.20	
		WORKSPACE GROUP PLC	27,747	239,456.61	
		銘柄数：4	456,278	2,041,866.17 (315,611,253)	
		組入時価比率：4.2%		4.7%	
	豪ドル	小計	CHARTER HALL GROUP	85,793	1,155,631.71
			GOODMAN GROUP	142,158	2,676,835.14
			SCENTRE GROUP	416,506	1,116,236.08
			銘柄数：3	644,457	4,948,702.93 (420,293,339)
			組入時価比率：5.6%		6.2%
	香港ドル	小計	LINK REIT	160,000	11,576,000.00
			銘柄数：1	160,000	11,576,000.00 (162,758,560)
			組入時価比率：2.2%		2.4%
	シンガポールドル	小計	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	156,100	316,883.00
			MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	635,900	1,290,877.00
MAPLETREE LOGISTICS TRUST			205,200	396,036.00	
銘柄数：3			997,200	2,003,796.00 (163,910,512)	
組入時価比率：2.2%				2.4%	
合計				6,787,284,880 (6,275,763,580)	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注4)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2021年 5月18日現在		
	契約額等(円)		時価(円)
	うち1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引			評価損益(円)

買建	76,049,517	-	76,004,023	45,494
米ドル	38,552,895	-	38,554,307	1,412
英ポンド	37,496,622	-	37,449,716	46,906
売建	37,496,622	-	37,417,483	79,139
米ドル	37,496,622	-	37,417,483	79,139
合計	-	-	-	33,645

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2 ファンドの現況

純資産額計算書

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

2021年6月30日現在

資産総額	14,283,917,914円
負債総額	6,895,492,739円
純資産総額（ - ）	7,388,425,175円
発行済口数	6,833,566,842口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0812円

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

2021年6月30日現在

資産総額	31,833,064,156円
負債総額	194,225,514円
純資産総額（ - ）	31,638,838,642円

発行済口数	27,527,765,662口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1493円

グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型

2021年6月30日現在

資産総額	1,519,455,028円
負債総額	729,672,709円
純資産総額（ - ）	789,782,319円
発行済口数	731,598,172口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0795円

グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型

2021年6月30日現在

資産総額	2,360,479,802円
負債総額	8,395,294円
純資産総額（ - ）	2,352,084,508円
発行済口数	2,046,436,570口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1494円

（参考）ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	10,778,352,176円
負債総額	356,670,635円
純資産総額（ - ）	10,421,681,541円
発行済口数	8,116,914,187口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2839円

（参考）米ドル建てE S G先進国社債 マザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	15,000,077,218円
負債総額	383,263,034円
純資産総額（ - ）	14,616,814,184円
発行済口数	13,870,107,114口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0538円

（参考）米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	6,431,776,667円
負債総額	164,931,225円
純資産総額（ - ）	6,266,845,442円
発行済口数	5,951,900,095口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0529円

（参考）ACI ESGグローバルREIT マザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	10,638,104,636円
負債総額	226,235,856円
純資産総額（ - ）	10,411,868,780円
発行済口数	8,061,787,840口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2915円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

< 更新後 >

(1) 資本金の額

2021年6月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構

(a) 会社の意思決定機構

当社は監査等委員会設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表取締役および監査等委員会を設けております。各機関の権限は以下のとおりです。

株主総会

株主により構成され、取締役・会計監査人の選任・解任、剰余金の配当の承認、定款変更・合併等の重要事項の承認等を行います。

取締役会

取締役により構成され、当社の業務につき意思決定を行います。また代表取締役等を選任し、取締役の職務の執行を監督します。

代表取締役・業務執行取締役

代表取締役を含む各業務執行取締役は、当社の業務の執行を行います。代表取締役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表取締役を含む業務執行取締役で構成される経営会議が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役員が含まれます。

監査等委員会

監査等委員である取締役3名以上（但し、過半数は社外取締役）で構成され、取締役の職務執行の適法性および妥当性に関する監査を行うとともに、株主総会に提出する会計監査人の選任・解任・不再任に関する議案の内容や監査等委員である取締役以外の取締役の選任・解任・辞任および報酬等についての監査等委員会としての意見を決定します。

(b)投資信託の運用体制



2 事業の内容及び営業の概況

< 更新後 >

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部及び投資助言業務を行っています。

委託者の運用する証券投資信託は2021年5月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	995	37,855,738
単位型株式投資信託	190	802,250
追加型公社債投資信託	14	6,366,572
単位型公社債投資信託	498	1,612,797
合計	1,697	46,637,357

3 委託会社等の経理状況

< 更新後 >

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(資産の部)					
流動資産					
現金・預金			2,626		4,281
金銭の信託			41,524		35,912
有価証券			24,399		30,400
前払費用			106		167
未収入金			522		632
未収委託者報酬			23,936		24,499
未収運用受託報酬			4,336		4,347
その他			71		268
貸倒引当金			14		14
流動資産計			97,509		100,496
固定資産					
有形固定資産			645		2,666
建物	2	295		1,935	
器具備品	2	349		731	
無形固定資産			5,894		5,429

ソフトウェア		5,893		5,428	
その他		0		0	
投資その他の資産			16,486		16,487
投資有価証券		1,437		1,767	
関係会社株式		10,171		9,942	
従業員長期貸付金		16		-	
長期差入保証金		329		330	
長期前払費用		19		15	
前払年金費用		1,545		1,301	
繰延税金資産		2,738		3,008	
その他		229		122	
貸倒引当金		0		-	
固定資産計			23,026		24,583
資産合計			120,536		125,080

区分	注記 番号	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			157		123
未払金			15,279		16,948
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		3		8	
未払手数料		6,948		7,256	
関係会社未払金		7,262		8,671	
その他未払金		1,063		1,011	
未払費用	1		10,290		9,171
未払法人税等			1,564		2,113
前受収益			26		22
賞与引当金			3,985		3,795
その他			67		-
流動負債計			31,371		32,175
固定負債					
退職給付引当金			3,311		3,299
時効後支払損引当金			572		580
資産除去債務			-		1,371
固定負債計			3,883		5,250
負債合計			35,254		37,425
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			85,270		87,596
資本剰余金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			54,360		56,686
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		53,675		56,001	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		29,069		31,395	

評価・換算差額等		10	57
その他有価証券評価差額金		10	57
純資産合計		85,281	87,654
負債・純資産合計		120,536	125,080

(2) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		115,736	106,355
運用受託報酬		17,170	16,583
その他営業収益		340	428
営業収益計		133,247	123,367
営業費用			
支払手数料		39,435	34,739
広告宣伝費		1,006	1,005
公告費		-	0
調査費		26,833	24,506
調査費		5,696	5,532
委託調査費		21,136	18,974
委託計算費		1,342	1,358
営業雑経費		5,823	4,149
通信費		75	73
印刷費		958	976
協会費		92	88
諸経費		4,696	3,011
営業費用計		74,440	65,760
一般管理費			
給料		11,418	10,985
役員報酬		109	147
給料・手当		7,173	7,156
賞与		4,134	3,682
交際費		86	35
旅費交通費		391	64
租税公課		1,029	1,121
不動産賃借料		1,227	1,147
退職給付費用		1,486	1,267
固定資産減価償却費		2,348	2,700
諸経費		10,067	10,739
一般管理費計		28,055	28,063
営業利益		30,751	29,542

		前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,936		4,540	
受取利息		0		0	
金銭の信託運用益		-		1,698	
その他		309		447	
営業外収益計			5,246		6,687
営業外費用					
金銭の信託運用損		230		-	
投資事業組合等評価損		146		-	
時効後支払損引当金繰入額		18		13	
為替差損		23		26	
その他		23		32	
営業外費用計			443		72
経常利益			35,555		36,157
特別利益					
投資有価証券等売却益		21		71	
株式報酬受入益		59		48	
移転補償金		-		2,077	
特別利益計			81		2,197
特別損失					
投資有価証券等評価損		119		36	
関係会社株式評価損		1,591		582	
固定資産除却損	2	67		105	
事務所移転費用		-		406	
特別損失計			1,778		1,129
税引前当期純利益			33,858		37,225
法人税、住民税及び事業税			9,896		11,239
法人税等調整額			34		290
当期純利益			23,996		26,276

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別 途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924
当期変動額									

剰余金の配当							25,650	25,650	25,650
当期純利益							23,996	23,996	23,996
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,653	1,653	1,653
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	33	33	86,958
当期変動額			
剰余金の配当			25,650
当期純利益			23,996
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	23	23	23
当期変動額合計	23	23	1,676
当期末残高	10	10	85,281

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270
当期変動額									
剰余金の配当							23,950	23,950	23,950
当期純利益							26,276	26,276	26,276
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,326	2,326	2,326
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	10	10	85,281
当期変動額			
剰余金の配当			23,950
当期純利益			26,276
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	46	46	46
当期変動額合計	46	46	2,372
当期末残高	57	57	87,654

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>						
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法						
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 <table style="margin-left: 40px;"> <tr> <td>建物</td> <td>6年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>6～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> </p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	6年	附属設備	6～15年	器具備品	4～15年
建物	6年						
附属設備	6～15年						
器具備品	4～15年						
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p>						

<p>5 . 消費税等の会計処理方法</p> <p>6 . 連結納税制度の適用</p>	<p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理していません。</p> <p>連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。</p>
---	--

[会計上の見積りに関する注記]

該当事項はありません。

[未適用の会計基準等]

- ・ 「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）
- ・ 「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されません。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日）

(1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針（以下「時価算定会計基準等」という。）が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

また「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」が改訂され、金融商品の時価のレベルごとの内訳等の注記事項が定められました。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2020年3月31日)	当事業年度末 (2021年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。 未払費用 1,296百万円	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。 未払費用 1,256百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 761百万円 器具備品 2,347 合計 3,109	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 346百万円 器具備品 643 合計 990

損益計算書関係

前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,931百万円	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,334百万円
2. 固定資産除却損 器具備品 7百万円 ソフトウェア 59	2. 固定資産除却損 器具備品 2百万円 ソフトウェア 102
合計 67	合計 105

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	25,650百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,980円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月28日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	23,950百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,650円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月30日

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	23,950百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,650円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月30日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	26,268百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,100円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月30日

金融商品関係

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リ

スクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2020年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	2,626	2,626	-
(2)金銭の信託	41,524	41,524	-
(3)未収委託者報酬	23,936	23,936	-
(4)未収運用受託報酬	4,336	4,336	-
(5)有価証券及び投資有価証券	24,399	24,399	-
その他有価証券	24,399	24,399	-
資産計	96,823	96,823	-
(6)未払金	15,279	15,279	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	3	3	-
未払手数料	6,948	6,948	-
関係会社未払金	7,262	7,262	-
その他未払金	1,063	1,063	-
(7)未払費用	10,290	10,290	-
(8)未払法人税等	1,564	1,564	-
負債計	27,134	27,134	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

譲渡性預金及びコマーシャル・ペーパーは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,437百万円、関係会社株式10,171百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。当事業年度において、非上場株式について2,416百万円（投資有価証券117百万円、関係会社株式2,298百万円）減損処理を行っております。なお、関係会社株式に係る評価損は、過年度に計上してありました関係会社株式に対する投資損失引当金の戻入益707百万円と相殺し、関係会社株式評価損1,591百万円を特別損失に計上しております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	2,626	-	-	-
金銭の信託	41,524	-	-	-
未収委託者報酬	23,936	-	-	-
未収運用受託報酬	4,336	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	24,399	-	-	-
合計	96,823	-	-	-

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を

目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	4,281	4,281	-
(2)金銭の信託	35,912	35,912	-
(3)未収委託者報酬	24,499	24,499	-
(4)未収運用受託報酬	4,347	4,347	-
(5)有価証券及び投資有価証券	30,400	30,400	-
その他有価証券	30,400	30,400	-
資産計	99,441	99,441	-
(6)未払金	16,948	16,948	-
未払収益分配金	0	0	-

未払償還金	8	8	-
未払手数料	7,256	7,256	-
関係会社未払金	8,671	8,671	-
その他未払金	1,011	1,011	-
(7)未払費用	9,171	9,171	-
(8)未払法人税等	2,113	2,113	-
負債計	28,233	28,233	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,767百万円、関係会社株式9,942百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について618百万円（投資有価証券35百万円、関係会社株式582百万円）減損処理を行っております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	4,281	-	-	-
金銭の信託	35,912	-	-	-
未収委託者報酬	24,499	-	-	-
未収運用受託報酬	4,347	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
其他有価証券	30,400	-	-	-
合計	99,441	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1．売買目的有価証券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2020年3月31日)

該当事項はありません。

4．其他有価証券(2020年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	4,400	4,400	-
コマーシャル・ペーパー	19,999	19,999	-
小計	24,399	24,399	-
合計	24,399	24,399	-

5．事業年度中に売却した其他有価証券（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．売買目的有価証券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2021年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2021年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	30,400	30,400	-
小計	30,400	30,400	-
合計	30,400	30,400	-

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
<p>1．採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。</p>
<p>2．確定給付制度</p>

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	23,551 百万円
勤務費用	1,034
利息費用	154
数理計算上の差異の発生額	138
退職給付の支払額	858
その他	17
退職給付債務の期末残高	23,761

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	17,469 百万円
期待運用収益	436
数理計算上の差異の発生額	393
事業主からの拠出額	566
退職給付の支払額	666
年金資産の期末残高	17,413

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	20,462 百万円
年金資産	17,413
	3,048
非積立型制度の退職給付債務	3,299
未積立退職給付債務	6,347
未認識数理計算上の差異	4,764
未認識過去勤務費用	185
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766
退職給付引当金	3,311
前払年金費用	1,545
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	1,034 百万円
利息費用	154
期待運用収益	436
数理計算上の差異の費用処理額	572
過去勤務費用の費用処理額	35
確定給付制度に係る退職給付費用	1,289

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	57%
株式	24%
生保一般勘定	12%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.6%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	23,761 百万円
勤務費用	1,016
利息費用	139
数理計算上の差異の発生額	893
退職給付の支払額	781
その他	28
退職給付債務の期末残高	23,270

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	17,413 百万円
期待運用収益	409
数理計算上の差異の発生額	1,328
事業主からの拠出額	824
退職給付の支払額	626
年金資産の期末残高	19,349

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	19,959 百万円
年金資産	19,349
	610
非積立型制度の退職給付債務	3,311
未積立退職給付債務	3,921
未認識数理計算上の差異	2,074
未認識過去勤務費用	151
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998
退職給付引当金	3,299
前払年金費用	1,301
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	1,016 百万円
利息費用	139
期待運用収益	409
数理計算上の差異の費用処理額	469
過去勤務費用の費用処理額	34
確定給付制度に係る退職給付費用	1,182

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	52%
株式	30%
生保一般勘定	11%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.8%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、206百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (2020年3月31日)	当事業年度末 (2021年3月31日)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
繰延税金資産 百万円	繰延税金資産 百万円
賞与引当金 1,235	賞与引当金 1,176
退職給付引当金 1,026	退職給付引当金 1,022
関係会社株式評価減 762	関係会社株式評価減 784
未払事業税 285	未払事業税 430
投資有価証券評価減 462	投資有価証券評価減 428
減価償却超過額 171	減価償却超過額 223
時効後支払損引当金 177	時効後支払損引当金 179
関係会社株式売却損 148	関係会社株式売却損 148
ゴルフ会員権評価減 167	ゴルフ会員権評価減 135
未払社会保険料 97	未払社会保険料 95
その他 219	その他 341
繰延税金資産小計 4,754	繰延税金資産小計 4,968
評価性引当額 1,532	評価性引当額 1,530
繰延税金資産合計 3,222	繰延税金資産合計 3,437
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 4	その他有価証券評価差額金 25
前払年金費用 478	前払年金費用 403
繰延税金負債合計 483	繰延税金負債合計 429
繰延税金資産の純額 2,738	繰延税金資産の純額 3,008
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率 31.0%	法定実効税率 31.0%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 0.0%	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 4.4%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 3.5%
タックスヘイブン税制 2.6%	タックスヘイブン税制 1.9%
外国税額控除 0.7%	外国税額控除 0.5%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税 0.2%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税 0.2%
その他 0.4%	その他 0.3%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 29.1%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 29.4%

資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を当該不動産賃貸借契約期間とし、割引率は0.0%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3．当該資産除去債務の総額の増減

（単位：百万円）				
	前事業年度		当事業年度	
	自 2019年4月 1日	至 2020年3月31日	自 2020年4月 1日	至 2021年3月31日
期首残高	-	-	-	-
有形固定資産の取得に伴う増加	-	-	1,371	-
時の経過による調整額	-	-	-	-
期末残高	-	-	1,371	-

セグメント情報等

前事業年度(自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)

1．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

関連当事者情報

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

(イ) 子会社等
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1)	31,378	未払手数料	5,536
							コマースナル・ペーパーの購入(*2)	20,000	有価証券	19,999
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

- (注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
(*1) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。
(*2) コマーシャル・ペーパーの購入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

野村ホールディングス㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、
ニューヨーク証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1)	26,722	未払手数料	5,690
							コマーシャル・ペーパーの償還(*2)	20,000	有価証券	-
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

- (注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
(*1) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

(*2) コマーシャル・ペーパーについては、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

野村ホールディングス㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、
ニューヨーク証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1株当たり情報

前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,557円31銭	1株当たり純資産額	17,018円01銭
1株当たり当期純利益	4,658円88銭	1株当たり当期純利益	5,101円61銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	23,996百万円	損益計算書上の当期純利益	26,276百万円
普通株式に係る当期純利益	23,996百万円	普通株式に係る当期純利益	26,276百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

第2【その他の関係法人の概況】

1 名称、資本金の額及び事業の内容

<更新後>

(1) 受託者

(a) 名称	(b) 資本金の額*	(c) 事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

* 2021年5月末現在

(2) 販売会社

(a) 名称	(b) 資本金の額*	(c) 事業の内容
ぐんぎん証券株式会社	3,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
静銀ティーエム証券株式会社	3,000百万円	
第四北越証券株式会社	600百万円	
とうほう証券株式会社	3,000百万円	
ひろぎん証券株式会社	5,000百万円	
北洋証券株式会社	500百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社池田泉州銀行	61,385百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	
株式会社神奈川銀行	6,191百万円	
株式会社紀陽銀行	80,096百万円	
株式会社京都銀行	42,103百万円	
株式会社群馬銀行	48,652百万円	
株式会社佐賀銀行	16,062百万円	
株式会社十六銀行	36,839百万円	
株式会社常陽銀行	85,113百万円	
株式会社但馬銀行	5,481百万円	
株式会社千葉銀行	145,069百万円	
株式会社中京銀行	31,844百万円	
株式会社筑波銀行	48,868百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	
株式会社富山銀行	6,730百万円	
株式会社長崎銀行	7,621百万円	
株式会社長野銀行	13,000百万円	
株式会社名古屋銀行	25,090百万円	
株式会社西日本シティ銀行	85,745百万円	
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	
株式会社広島銀行	54,573百万円	
株式会社福井銀行	17,965百万円	
株式会社福岡中央銀行	4,000百万円	
株式会社福島銀行	18,682百万円	
株式会社北洋銀行	121,101百万円	
株式会社北陸銀行	140,409百万円	
株式会社みちのく銀行	36,986百万円	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社山形銀行	12,008百万円	
株式会社琉球銀行	56,967百万円	

* 2021年5月末現在

(3) 運用の委託先

(a) 名称	(b) 資本金の額	(c) 事業の内容
American Century Investment Management, Inc. (アメリカン・センチュリー・インベストメント・マネジメント・インク)	16,207,000米ドル ^{*1}	資産運用業務を行なっています。
NOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED (ノムラ・アセット・マネジメント・U.K.・リミテッド)	4,744,391 ^{*2}	英国の1986年金融サービス業法に基づき英国金融サービス庁に登録された当該法律の定める範囲内で行う投資顧問業およびそれに付随する一切の業務を営んでいます。

*1 2020年12月末現在

*2 2021年3月末現在

独立監査人の監査報告書

2021年7月1日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型の2020年11月30日から2021年5月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型の2021年5月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

野村アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2021年7月1日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型の2020年11月30日から2021年5月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型の2021年5月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

野村アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2021年7月1日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型の2020年11月30日から2021年5月18日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型の2021年5月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

野村アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2021年7月1日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型の2020年11月30日から2021年5月18日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型の2021年5月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

野村アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2021年6月7日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 亀井 純子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 津村 健二郎指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 水 永 真太郎

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第62期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成すること

が適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。